

Price Movement

Single Stock Futures เริ่มเปิดทำการซื้อขายเป็นครั้งแรกในเดือนนี้ (24 พ.ย. 51) โดยราคาซื้อขายมีการเคลื่อนไหวเป็นไปในทิศทางเดียวกับราคาหุ้นสามัญที่เป็นสินค้าอ้างอิง

ดัชนี SET50 มีความผันผวนอย่างหนัก แต่ขยับไปไหนไม่ได้ไกล แม้จะมีปัจจัยบวกจากการฟื้นตัวของตลาดต่างประเทศ แต่ปัจจัยภายในประเทศค่อนข้างอยู่ในเชิงลบจากการที่กลุ่มพันธบัตรฯ เข้ายึดสนามบิณฑกเมืองและสุวรรณภูมิ เป็นเหตุให้ต้องหยุดการบินทั้งหมด ทำให้รัฐบาลได้ประกาศใช้พรก.สถานการณ์ฉุกเฉินในคืนวันที่ 27 พ.ย. 51 ในเขตพื้นที่ตอนเมืองและสุวรรณภูมิ

SET50 ปรับตัวลดลงจากเดือนก่อน -8.93 จุด หรือ -3.09% และ S50Z08 (Nearest series) ปรับตัวลดลงจากเดือนก่อน -2.80 จุด หรือ -1.00% ซึ่งเป็นไปในทิศทางเดียวกับ SET50

	High	Low	Settlement Price	Change (points)	Change %
SET50	327.58	265.14	279.83	- 8.93	- 3.09
S50Z08	333.30	255.30	277.10	- 2.80	- 1.00
S50H09	332.00	254.20	274.70	- 3.30	- 1.19
S50M09	331.50	256.00	274.20	- 4.80	- 1.72
S50U09	330.00	256.90	272.60	- 7.60	- 2.71

*** Change : เปลี่ยนเทียบกับราคาปิดและราคา Settlement price ของ SET50 และ SET50 Index Futures ของเดือนก่อนหน้า

Trading Statistics

ตลาดอนุพันธ์มีการซื้อขายในเดือนพ.ย. รวมทั้งสิ้น 275,040 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 79,508.39 ล้านบาท แบ่งเป็น SET50 Index Futures มีการซื้อขาย 270,816 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 79,406.81 ล้านบาท SET50 Index Options มีการซื้อขาย 3,318 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 14.49 ล้านบาท และ Single Stock Futures มีการซื้อขาย 906 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 87.09 บาท

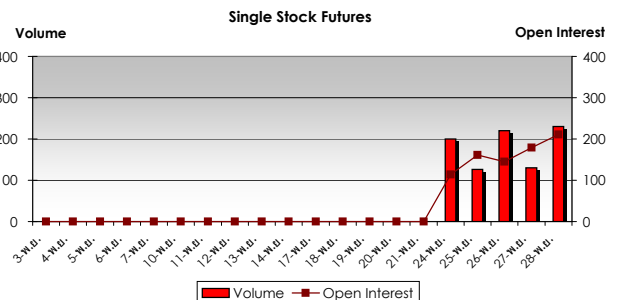
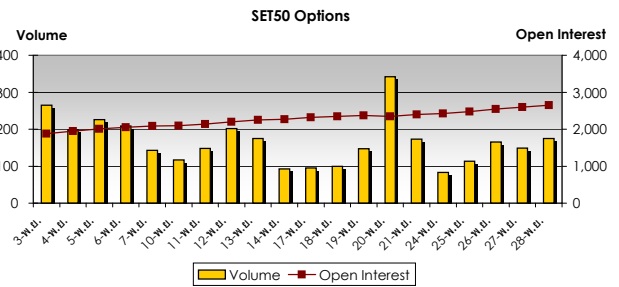
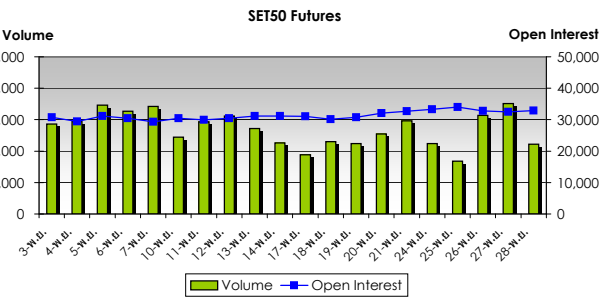
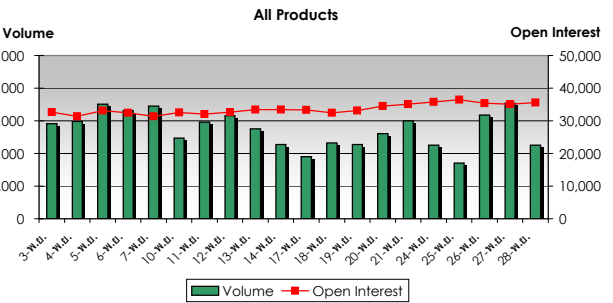
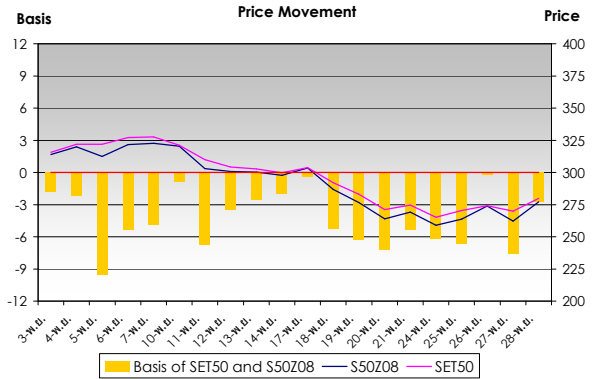
ทั้งนี้ ปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในเดือนพฤศจิกายน เท่ากับ 13,888 สัญญา หรือคิดเป็นมูลค่า 3,988.48 ล้านบาท ลดลงเท่ากับ 312 สัญญา หรือเท่ากับ 534.43 ล้านบาท เมื่อเทียบกับเดือนก่อนหน้า และปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันช่วง 11 เดือนแรกของปีเท่ากับ 8,625 สัญญา หรือคิดเป็นมูลค่า 3,851.63 ล้านบาท

	Volume (Contracts)		Value (M.Baht)		Open Interest
	Average	Total	Average	Total	
SET50 Futures	13,541	270,816	3,970.34	79,406.81	32,937
SET50 Options	166	3,318	0.72	14.49	2,652
Call	62	1,237	0.17	3.49	1,381
Put	104	2,081	0.55	11.00	1,271
Total SET50 Index Market	13,707	274,134	3,971.07	79,421.30	35,589
Advance Futures	65	327	4.85	24.25	48
PITEP Futures	65	323	5.50	27.48	118
PIT Futures	51	256	7.07	35.36	45
Total Single Stock Market	181	906	17.42	87.09	211
Total All Market	13,888	275,040	3,988.48	79,508.39	35,800

Series Comparison

สัญญาที่มีการซื้อขายมากที่สุดในเดือนนี้ สำหรับ SET50 Index Futures ได้แก่ S50Z08 ขณะที่ SET50 Call Options ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ S50Z08C370, Put Options ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ S50Z08P260 โดยมีอัตรา Put/Call ratio อยู่ที่ประมาณ 1.68 เท่า และ ADVANCZ08 เป็นสัญญาที่มีการซื้อขายมากที่สุด สำหรับ Stock Futures

	Volume		Open Interest	
	Contracts	%	Contracts	%
SET50 Index Futures				
S50Z08	261,030	96.39	31,247	94.87
S50H09	7,920	2.92	1,334	4.05
S50M09	1,067	0.39	223	0.68
S50U09	799	0.30	133	0.40
Total SET50 Futures	270,816	100.00	32,937	100.00
SET50 Index Call Options (Most Active)				
S50Z08C370	186	15.04	129	12.86
S50Z08C320	166	13.42	59	5.88
S50Z08C330	117	9.46	47	4.69
Total SET50 Call Options	1,237	100.00	1,003	100.00
SET50 Index Put Options (Most Active)				
S50Z08P260	295	14.18	109	8.79
S50Z08P250	293	14.08	145	11.69
S50Z08P210	197	9.47	125	10.08
Total SET50 Put Options	2,081	100.00	1,240	100.00
Single Stock Futures (Most Active)				
ADVANCZ08	327	36.13	48	22.86
PITEPZ08	323	35.69	118	56.19
PITZ08	255	28.18	44	20.95
Total Single Stock Futures	905	100.00	210	100.00

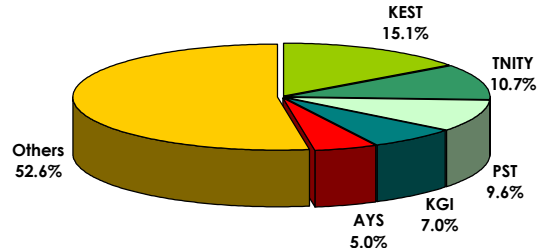


Broker Rank

บล. กิมเฮ้ง มีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด ตามด้วย บล.ทรีนิตี้ บล.ฟิลิปส์ บล.เคจีไอ และบล.กรุงศรีอยุธยา ตามลำดับ โดยสมาชิกที่มีการซื้อขายสูงสุด 5 อันดับแรกมีการซื้อขายรวมกัน คิดเป็น 47.4% ของตลาด

ทั้งนี้ บล.ทรีนิตี้ มีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุดในรอบ 11 เดือน โดยมีสัดส่วนการซื้อขายรวม คิดเป็น 13.1% ตามด้วย บล.กิมเฮ้ง และบล.ฟิลิปส์ คิดเป็น 12.9% และ 10.2% ตามลำดับ

Top 10 Active Brokers			
Rank	Broker	Volume	%
1	KEST	83,085	15.1
2	TNITY	58,897	10.7
3	PST	52,898	9.6
4	KGI	38,308	7.0
5	AYS	27,358	5.0
6	SSEC	25,655	4.7
7	ZMICO	24,082	4.4
8	BLS	24,052	4.4
9	KKS	22,479	4.1
10	ASP	20,596	3.7

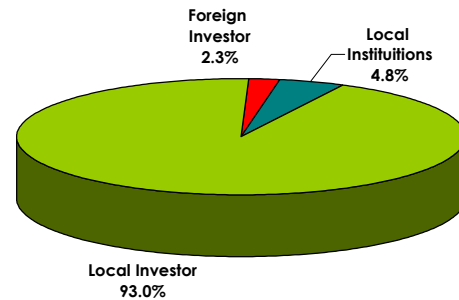


No. of Account Opened

ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนของจำนวนการเปิดบัญชีซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 93.0% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ คิดเป็น 4.8% และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 2.3%

ทั้งนี้ จำนวนบัญชีของลูกค้ายกเว้นที่ปรับตัวลดลง เกิดจากจำนวนบัญชีเพื่อการซื้อขายของบริษัทสมาชิกที่ลดลง

	Nov-08	Oct-08	Change
Local Institutions	719	727	-8
Local Investor	14,046	13,020	1,026
Foreign Investor	340	322	18
Total	15,105	14,069	1,036



Investor Type

ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 62.0% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ คิดเป็น 30.0% และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 8.0% ซึ่งมีสัดส่วนใกล้เคียงกับปริมาณการซื้อขายในรอบ 11 เดือน ที่ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขาย คิดเป็น 56.8% ผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 26.6% และ 16.5% ตามลำดับ

	Volume		
	Buy	Sell	Total
Local Institutions	81,412	83,663	165,075
Local Investor	170,439	170,597	341,036
Foreign Investor	23,189	20,780	43,969

