

Market Wrap Up

***สมาชิกผู้ค้าลงรายใหม่ 4 รายได้แก่ HGF MTSGF TCAF และ YLG เริ่มทำการซื้อขายในตลาดอนุพันธ์เป็นครั้งแรกในเดือนนี้ (2 มี.ค. 52) นอกจากนี้ ตลาดอนุพันธ์ได้ปรับเกณฑ์การซื้อขายผ่านระบบอินเทอร์เน็ต โดยขยับเพดานปริมาณการซื้อขาย และปลดเกณฑ์จำกัดราคาซื้อขาย 5% พร้อมขยายการแสดงผลข้อมูลราคาเสนอซื้อขาย (Best bid/Best offer) จาก 3 ระดับเป็น 5 ระดับสำหรับทุกช่องทาง ในเดือนนี้เช่นเดียวกัน (23 มี.ค. 52)

ดัชนี SET50 เคลื่อนไหวผันผวนในแดนบวกสลับลบตลอดเดือน ซึ่งเป็นไปในทิศทางเดียวกับตลาดหุ้นต่างประเทศ และจากแรงกดดันบางส่วนของปัจจัยการเมืองภายในประเทศที่กลุ่มคนเสื้อแดงชุมนุมปิดล้อมท่าเทียบเรือท่าเรือพาณิชย์

SET50 ปรับตัวเพิ่มขึ้นจากเดือนก่อน 0.62 จุด หรือ 0.21% และ S50H09 (Nearest series) ปรับตัวเพิ่มขึ้นจากเดือนก่อน 6.70 จุด หรือ 2.30% ซึ่งเป็นไปในทิศทางเดียวกับ SET50

	High	Low	Settlement Price	Change (points)	Change %
SET50	307.96	284.25	300.20	0.62	0.21
S50H09	310.40	274.20	298.20	6.70	2.30
S50M09	307.70	266.60	293.20	8.60	3.02
S50U09	300.50	267.00	287.80	2.70	0.95
S50Z09	299.90	265.60	286.00	3.60	1.27
S50H10	294.50	270.00	282.30	-	-

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

Trading Statistics

ตลาดอนุพันธ์มีการซื้อขายในเดือนมี.ค. รวมทั้งสิ้น 200,038 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 64,281.93 ล้านบาท ปริมาณการซื้อขายส่วนใหญ่เป็นของ SET50 Index Futures คิดเป็น 97.90% ของทั้งตลาด โดยมีการซื้อขายทั้งสิ้นเท่ากับ 178,399 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 52,066.16 ล้านบาท SET50 Index Options มีการซื้อขาย 3,834 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 7.98 ล้านบาท Single Stock Futures มีการซื้อขาย 2,841 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 258.73 ล้านบาท และ Gold Futures มีการซื้อขาย 14,964 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 11,949.07 ล้านบาท และจำนวนสถานะคงค้างรวมทุกสินค้าอ้างอิงเท่ากับ 27,744 สัญญา

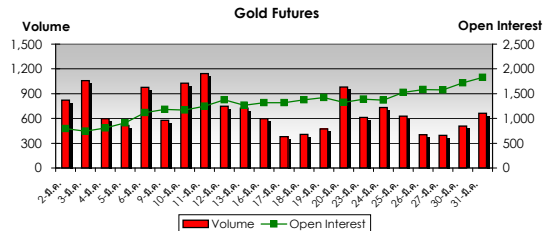
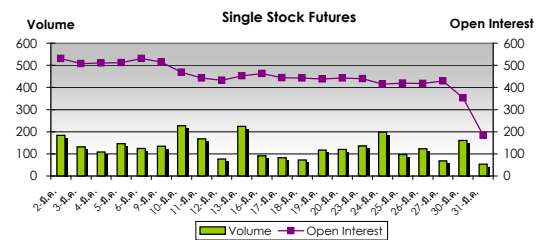
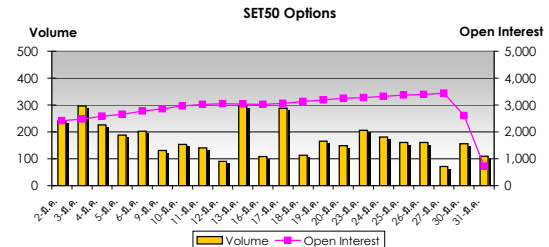
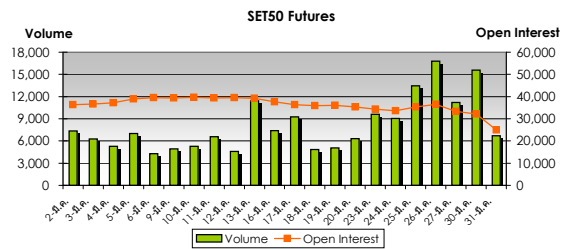
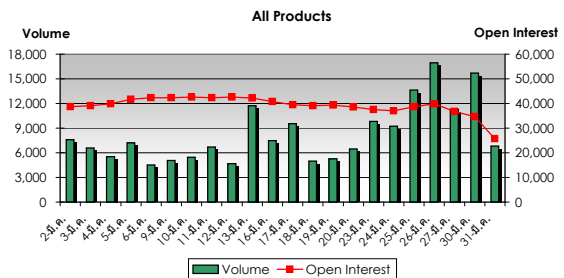
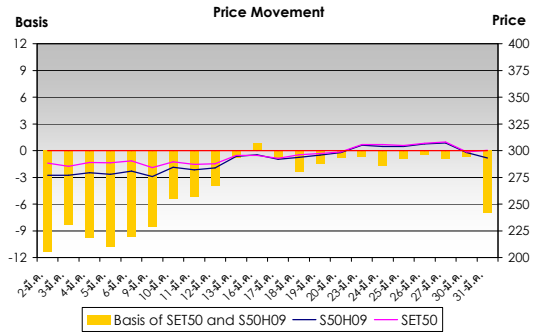
ทั้งนี้ ปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในเดือนมีนาคมเท่ากับ 9,093 สัญญา หรือคิดเป็นมูลค่า 2,921.91 ล้านบาท เพิ่มขึ้นเท่ากับ 2,890 สัญญา หรือเท่ากับ 989.65 ล้านบาท เมื่อเทียบกับเดือนก่อนหน้า และปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในช่วง 3 เดือนแรกของปีเท่ากับ 8,621 สัญญา หรือคิดเป็นมูลค่า 2,757.72 ล้านบาท

	Volume (Contracts)		Value (M.Baht)		Open Interest
	Average	Total	Average	Total	
SET50 Futures	8,109	178,399	2,366.64	52,066.16	25,005
SET50 Options	174	3,834	0.36	7.98	727
Call	66	1,452	0.13	2.95	281
Put	108	2,382	0.23	5.03	446
Total SET50 Index Market	8,283	182,233	2,367.01	52,074.14	25,732
Advance Futures	42	927	3.39	74.59	96
PTTEP Futures	82	1,804	7.61	167.43	82
PTT Futures	5	110	0.76	16.70	6
Total Single Stock Market	129	2,841	11.76	258.73	184
Gold Futures	680	14,964	543.14	11,949.07	1,828
Total Gold Market	680	14,964	543.14	11,949.07	1,828
Total All Market	9,093	200,038	2,921.91	64,281.93	27,744

Series Comparison

สัญญาที่มีการซื้อขายมากที่สุดในเดือนนี้ สำหรับ SET50 Index Futures ได้แก่ S50H09 ขณะที่ SET50 Call Options ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ S50H09C290, Put Options ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ S50H09P300 โดยมีอัตรา Put/Call ratio อยู่ที่ประมาณ 1.64 เท่า สำหรับ Stock Futures ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ PTTEPH09X และ Gold Futures สัญญา GFJ09 เป็นสัญญาที่มีการซื้อขายมากที่สุดในเดือนนี้

	Volume		Open Interest	
	Contracts	%	Contracts	%
SET50 Index Futures				
S50H09	109,808	61.55	-	-
S50M09	67,516	37.85	24,418	97.65
S50U09	754	0.42	415	1.66
S50Z09	307	0.17	160	0.64
S50H10	14	0.01	12	0.05
Total SET50 Futures	178,399	100.00	25,005	100.00
SET50 Index Call Options (Most Active)				
S50H09C290	337	23.21	-	-
S50H09C280	290	19.97	-	-
S50H09C300	263	18.11	-	-
Total SET50 Call Options	1,452	100.00	281	100.00
SET50 Index Put Options (Most Active)				
S50H09P300	391	16.41	-	-
S50H09P280	378	15.87	-	-
S50H09P290	311	13.06	-	-
Total SET50 Put Options	2,382	100.00	446	100.00
Single Stock Futures (Most Active)				
PTTEPH09X	1,589	55.93	58	31.52
ADVANCH09	721	25.38	109	59.24
PTTEPM09X	215	7.57	82	44.57
Total Single Stock Futures	2,841	100.00	184	100.00
Gold Futures				
GFJ09	14,695	98.20	1,730	94.64
GFU09	259	1.73	97	5.31
GFQ09	10	0.07	1	0.05
Total Gold Futures	14,964	100.00	1,828	100.00

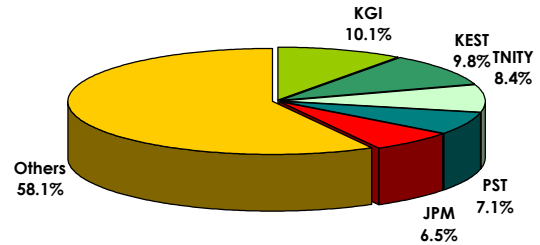


Broker Rank

บล.เคจีไอ มีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด ตามด้วย บล.กิมเอ็ง บล.ทริเน็ต บล.ฟิลิปส์ และบล.เจที มอร์แกน ตามลำดับ โดยสมาชิกที่มีการซื้อขายสูงสุด 5 อันดับแรกมีการซื้อขายรวมกัน คิดเป็น 41.9% ของตลาด

ทั้งนี้ บล. กิมเอ็ง มีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุดในช่วง 3 เดือนแรกของปีนี้ โดยมีสัดส่วนการซื้อขายรวม คิดเป็น 12.5% ตามด้วย บล.เคจีไอ และบล.ทริเน็ต คิดเป็น 9.1% และ 9.0% ตามลำดับ

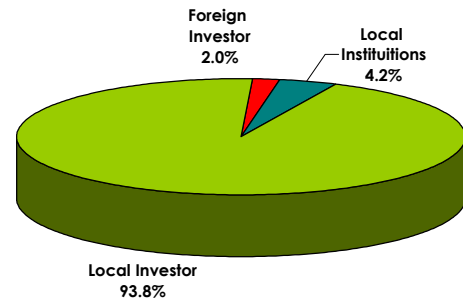
Top 10 Active Brokers			
Rank	Broker	Volume	%
1	KGI	40,470	10.1
2	KEST	39,250	9.8
3	TNITY	33,663	8.4
4	PST	28,261	7.1
5	JPM	25,900	6.5
6	PHATR	25,587	6.4
7	ASP	11,293	2.8
8	KKS	11,251	2.8
9	TSC	10,677	2.7
10	KS	10,552	2.6



No. of Account Opened

ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนของจำนวนการเปิดบัญชีซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 93.8% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ คิดเป็น 4.2% และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 2.0%

	Mar-09	Feb-09	Change
Local Institutions	817	809	8
Local Investor	18,061	16,792	1,269
Foreign Investor	385	371	14
Total	19,263	17,972	1,291



Investor Type

ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 49.7% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ คิดเป็น 23.0% และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 27.3% ซึ่งมีสัดส่วนใกล้เคียงกับปริมาณการซื้อขายในช่วง 3 เดือนแรกของปีนี้ ที่ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขาย คิดเป็น 56.5% ผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 26.9% และ 16.7% ตามลำดับ

	Volume		
	Buy	Sell	Total
Local Institutions	43,101	48,997	92,098
Local Investor	99,017	99,832	198,849
Foreign Investor	57,920	51,209	109,129

