

**Price Movement**

ดัชนี SET50 เคลื่อนไหวผันผวนเช่นเดียวกับตลาดหุ้นต่างประเทศ โดยได้รับปัจจัยบวกจากราคาน้ำมันที่ปรับตัวสูงขึ้นอย่างต่อเนื่องหนุนหุ้นพลังงานปรับตัวต่อเนื่อง แม้จะเผชิญกับข่าวลบเข้ามาเป็นระยะ อาทิเช่น การประกาศจัดพีดีอีราส 1/52 ที่ปรับตัวลดลงมากกว่า 7.1% ขาที่บูตส์เตรียมพิจารณาบททวนปรับลดอันดับเครดิตของธนาคารไทย 11 แห่งก็ตาม ทาตลาดก็ขึ้นตัวกลับมาได้ในช่วงเวลาอันรวดเร็ว

SET50 ปรับตัวเพิ่มขึ้นจากเดือนก่อน 51.55 จุด หรือ 14.86% และ S50M09 (Nearest series) ปรับตัวเพิ่มขึ้นจากเดือนก่อน 55.20 จุด หรือ 16.09% ซึ่งเป็นไปในทิศทางเดียวกับ SET50

|        | High   | Low    | Settlement Price | Change (points) | Change % |
|--------|--------|--------|------------------|-----------------|----------|
| SET50  | 401.46 | 358.76 | 398.36           | 51.55           | 14.86    |
| S50M09 | 406.30 | 348.10 | 398.30           | 55.20           | 16.09    |
| S50U09 | 402.70 | 344.20 | 393.70           | 53.80           | 15.83    |
| S50Z09 | 399.90 | 342.30 | 392.00           | 53.80           | 15.91    |
| S50H10 | 399.00 | 343.00 | 392.20           | 56.20           | 16.73    |

\*\*\* Change : เปลี่ยนเทียบกับราคารับและราคา Settlement price ของ SET50 และ SET50 Index Futures ของเดือนก่อนหน้า

**Trading Statistics**

ตลาดอนุพันธ์มีการซื้อขายในเดือนพ.ค. รวมทั้งสิ้น 224,026 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 86,335.04 ล้านบาท ปริมาณการซื้อขายส่วนใหญ่เป็นของ SET50 Index Futures คิดเป็น 90.72% ของทั้งตลาด โดยมีการซื้อขายทั้งสิ้นเท่ากับ 203,245 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 78,181.60 ล้านบาท SET50 Index Options มีการซื้อขาย 7,329 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 20.38 ล้านบาท Single Stock Futures มีการซื้อขาย 3,436 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 413.36 ล้านบาท และ Gold Futures มีการซื้อขาย 10,016 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 7,719.70 ล้านบาท

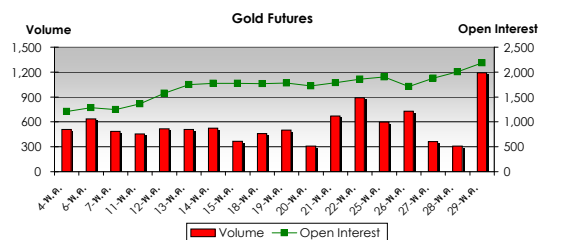
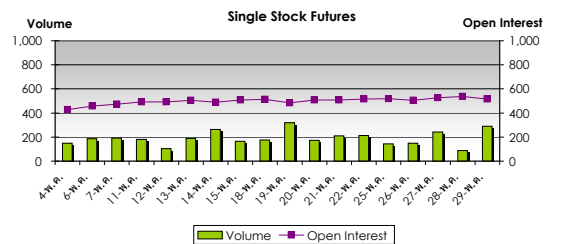
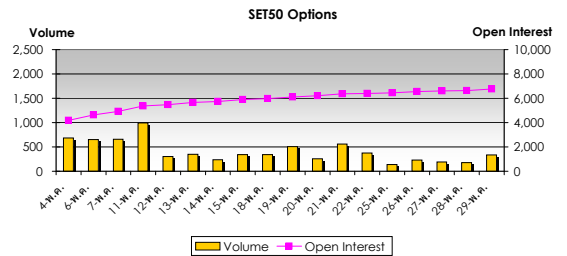
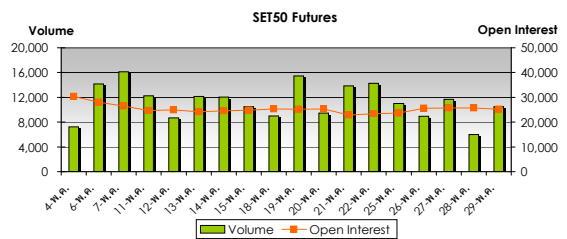
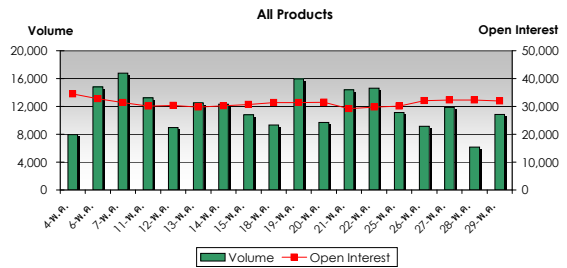
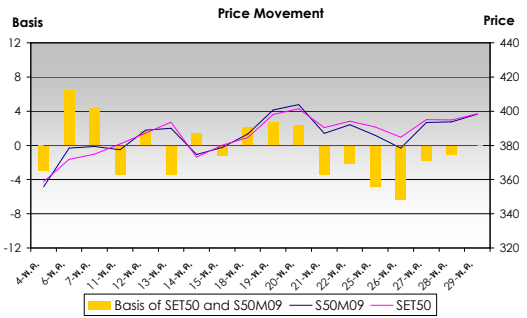
ทั้งนี้ ปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในเดือนพฤษภาคมเท่ากับ 12,446 สัญญา หรือคิดเป็นมูลค่า 4,796.39 ล้านบาท เพิ่มขึ้นเท่ากับ 3,853 สัญญา หรือเพิ่มขึ้นเท่ากับ 1,887.74 ล้านบาท เมื่อเทียบกับเดือนก่อนหน้า และปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในช่วง 5 เดือนของปีเท่ากับ 9,336 สัญญา หรือคิดเป็นมูลค่า 3,170.14 ล้านบาท

|                                  | Volume (Contracts) |                | Value (M.Baht)  |                  | Open Interest |
|----------------------------------|--------------------|----------------|-----------------|------------------|---------------|
|                                  | Average            | Total          | Average         | Total            |               |
| SET50 Futures                    | 11,291             | 203,245        | 4,343.42        | 78,181.60        | 25,247        |
| SET50 Options                    | 407                | 7,329          | 1.13            | 20.38            | 6,760         |
| Call                             | 222                | 3,987          | 0.79            | 14.29            | 2,830         |
| Put                              | 186                | 3,342          | 0.34            | 6.09             | 3,930         |
| <b>Total SET50 Market</b>        | <b>11,699</b>      | <b>210,574</b> | <b>4,344.55</b> | <b>78,201.98</b> | <b>32,007</b> |
| Advance Futures                  | 27                 | 489            | 2.16            | 38.82            | 250           |
| PTTEP Futures                    | 153                | 2,742          | 18.63           | 335.31           | 223           |
| PIT Futures                      | 10                 | 185            | 2.18            | 39.23            | 42            |
| <b>Total Single Stock Market</b> | <b>191</b>         | <b>3,436</b>   | <b>22.96</b>    | <b>413.36</b>    | <b>515</b>    |
| Gold Futures                     | 556                | 10,016         | 428.87          | 7,719.70         | 2,183         |
| <b>Total Gold Market</b>         | <b>556</b>         | <b>10,016</b>  | <b>428.87</b>   | <b>7,719.70</b>  | <b>2,183</b>  |
| <b>Total All Market</b>          | <b>12,446</b>      | <b>224,026</b> | <b>4,796.39</b> | <b>86,335.04</b> | <b>34,705</b> |

**Series Comparison**

สัญญาที่มีการซื้อขายมากที่สุดในเดือนนี้ สำหรับ SET50 Index Futures ได้แก่ S50M09 ขณะที่ SET50 Call Options ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ S50M09C390, Put Options ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ S50M09P380 โดยมีอัตรา Put/Call ratio อยู่ที่ประมาณ 0.84 เท่า สำหรับ Stock Futures ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ PTTEPM09X และ Gold Futures สัญญา GFM09 เป็นสัญญาที่มีการซื้อขายมากที่สุด

|   | Volume         |               | Open Interest |               |
|---|----------------|---------------|---------------|---------------|
|   | Contracts      | %             | Contracts     | %             |
| <b>SET50 Index Futures</b>                    |                |               |               |               |
| S50M09  | 187,618        | 92.31         | 23,383        | 92.62         |
| S50U09  | 14,686         | 7.23          | 1,595         | 6.32          |
| S50Z09  | 656            | 0.32          | 183           | 0.72          |
| S50H10  | 285            | 0.14          | 86            | 0.34          |
| <b>Total SET50 Futures</b>                    | <b>203,245</b> | <b>100.00</b> | <b>25,247</b> | <b>100.00</b> |
| <b>SET50 Index Call Options (Most Active)</b> |                |               |               |               |
| S50M09C390                                    | 717            | 17.98         | 184           | 6.50          |
| S50M09C400                                    | 698            | 17.51         | 242           | 8.55          |
| S50M09C380                                    | 647            | 16.23         | 197           | 6.96          |
| <b>Total SET50 Call Options</b>               | <b>3,987</b>   | <b>100.00</b> | <b>2,830</b>  | <b>100.00</b> |
| <b>SET50 Index Put Options (Most Active)</b>  |                |               |               |               |
| S50M09P380                                    | 502            | 15.02         | 304           | 7.74          |
| S50M09P340                                    | 477            | 14.27         | 308           | 7.84          |
| S50M09P350                                    | 450            | 13.46         | 228           | 5.80          |
| <b>Total SET50 Put Options</b>                | <b>3,342</b>   | <b>100.00</b> | <b>3,930</b>  | <b>100.00</b> |
| <b>Single Stock Futures (Most Active)</b>     |                |               |               |               |
| PTTEPM09X                                     | 2,760          | 80.33         | 221           | 42.91         |
| ADVANC09                                      | 389            | 11.32         | 172           | 33.40         |
| PITM09  | 182            | 5.30          | 40            | 7.77          |
| <b>Total Single Stock Futures</b>             | <b>3,436</b>   | <b>100.00</b> | <b>515</b>    | <b>100.00</b> |
| <b>Gold Futures</b>                           |                |               |               |               |
| GFM09   | 9,182          | 91.67         | 1,831         | 18.28         |
| GFO09   | 750            | 7.49          | 293           | 2.93          |
| GFV09   | 84             | 0.84          | 59            | 0.59          |
| <b>Total Gold Futures</b>                     | <b>10,016</b>  | <b>100.00</b> | <b>2,183</b>  | <b>100.00</b> |



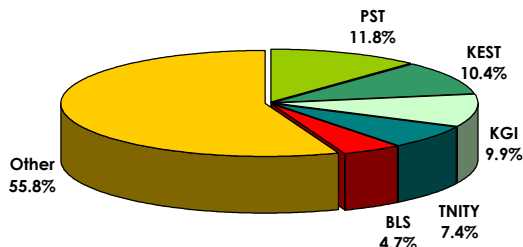
**Disclaimer:** This document provides general information only. It should not be considered as an investment advice. Although every attempt has been made to ensure the accuracy of the information, TFX and its affiliates assume no responsibility for any error

## Broker Rank

บล. ฟิลิปส์ มีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด ตามด้วย บล. กิมเ็ง บล. เคจีไอ บล. ทรินิตี้ และ บล. บัวหลวง ตามลำดับ โดยสมาชิกที่มีการซื้อขายสูงสุด 5 อันดับแรกมีการซื้อขายรวมกัน คิดเป็น 44.2% ของตลาด

ทั้งนี้ บล. กิมเ็ง มีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุดในช่วง 5 เดือนแรกของปี โดยมีสัดส่วนการซื้อขายรวม คิดเป็น 11.8% ตามด้วย บล. ฟิลิปส์ และ บล. เคจีไอ คิดเป็น 9.8% และ 8.9% ตามลำดับ

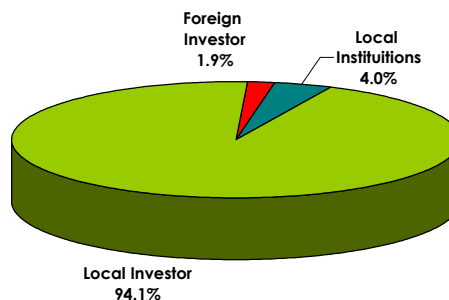
| Top 10 Active Brokers |        |        |      |
|-----------------------|--------|--------|------|
| Rank                  | Broker | Volume | %    |
| 1                     | PST    | 53,017 | 11.8 |
| 2                     | KEST   | 46,390 | 10.4 |
| 3                     | KGI    | 44,391 | 9.9  |
| 4                     | TNITY  | 32,956 | 7.4  |
| 5                     | BLS    | 21,106 | 4.7  |
| 6                     | KKS    | 18,569 | 4.1  |
| 7                     | GBS    | 17,448 | 3.9  |
| 8                     | PHATR  | 17,086 | 3.8  |
| 9                     | TNS    | 15,913 | 3.6  |
| 10                    | ASP    | 14,845 | 3.3  |



## No. of Account Opened

ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนของจำนวนการเปิดบัญชีซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 94.1% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ คิดเป็น 4.0% และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 1.9%

|                    | May-09        | Apr-09        | Change       |
|--------------------|---------------|---------------|--------------|
| Local Institutions | 845           | 833           | 12           |
| Local Investor     | 19,725        | 18,655        | 1,070        |
| Foreign Investor   | 397           | 390           | 7            |
| <b>Total</b>       | <b>20,967</b> | <b>19,878</b> | <b>1,089</b> |



## Investor Type

ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 56.8% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ คิดเป็น 31.9% และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 11.3% ซึ่งมีสัดส่วนใกล้เคียงกับปริมาณการซื้อขายในช่วง 5 เดือนแรกของปี ที่ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขาย คิดเป็น 57.3% ผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 28.4% และ 14.3% ตามลำดับ

|                    | Volume  |         |         |
|--------------------|---------|---------|---------|
|                    | Buy     | Sell    | Total   |
| Local Institutions | 69,555  | 73,304  | 142,859 |
| Local Investor     | 130,081 | 124,290 | 254,371 |
| Foreign Investor   | 24,390  | 26,432  | 50,822  |

