

Price Movement

***ตลาดอนุพันธ์ได้เปิดซื้อขาย Stock Futures เพิ่มเดิมอีก 11 ตัว ได้แก่ BANPU BAY BBL ITD KBANK KTB LH QH SCB SCC TTA ในเดือนนี้ (22 มิ.ย. 52)

ดัชนี SET50 เคลื่อนไหวค่อนข้างผันผวนเช่นเดียวกับตลาดหุ้นต่างประเทศ โดยได้รับอานิสงส์จากการฟื้นตัวของราคาน้ำมันในตลาดโลก และในช่วงกลางเดือนตลาดหุ้นไทยพุ่งขึ้นทำระดับปีสูงสุดในรอบปีที่ 628.55 จุด ทำให้เริ่มเห็นภาพการปรับฐานของตลาดสลับเข้ามาอย่างต่อเนื่องเป็นระยะจนกระทั่งปิดงวดบัญชีในช่วงปลายเดือนไตรมาส 2

SET50 ปรับตัวเพิ่มขึ้นจากเดือนก่อน 31.99 จุด หรือ 8.03% และ S50M09 (Nearest series) ปรับตัวเพิ่มขึ้นจากเดือนก่อน 35.51 จุด หรือ 8.92% ซึ่งเป็นไปในทิศทางเดียวกัน SET50

	High	Low	Settlement Price	Change (points)	Change %
SET50	454.61	407.99	430.35	31.99	8.03
S50M09	459.70	398.60	433.81	35.51	8.92
S50U09	453.80	393.00	426.70	33.00	8.38
S50Z09	452.00	393.00	426.10	34.10	8.70
S50H10	453.00	394.00	425.00	32.80	8.36
S50M10	-	-	421.30	-	-

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

Trading Statistics

ตลาดอนุพันธ์มีการซื้อขายในเดือนมิ.ย. รวมทั้งสิ้น 363,935 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 154,113.91 ล้านบาท ปริมาณการซื้อขายส่วนใหญ่เป็นของ SET50 Index Futures คิดเป็น 90.10% ของทั้งหมด โดยมีการซื้อขายทั้งสิ้นเท่ากับ 327,907 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 139,240.41 ล้านบาท SET50 Index Options มีการซื้อขาย 9,833 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 24.26 ล้านบาท Single Stock Futures มีการซื้อขาย 8,142 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 875.02 ล้านบาท และ Gold Futures มีการซื้อขาย 1,853 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 13,974.22 ล้านบาท

ทั้งนี้ ปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในเดือนมิถุนายนเท่ากับ 16,542 สัญญา หรือคิดเป็นมูลค่า 7,005.18 ล้านบาท เพิ่มขึ้นเท่ากับ 4,096 สัญญา หรือเพิ่มขึ้นเท่ากับ 2,208.79 ล้านบาท เมื่อเทียบกับเดือนก่อนหน้า และปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในช่วงครึ่งปีแรกเท่ากับ 10,678 สัญญา หรือคิดเป็นมูลค่า 3,886.45 ล้านบาท

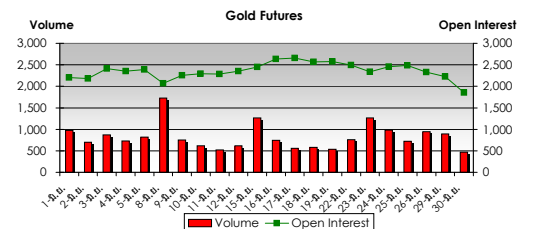
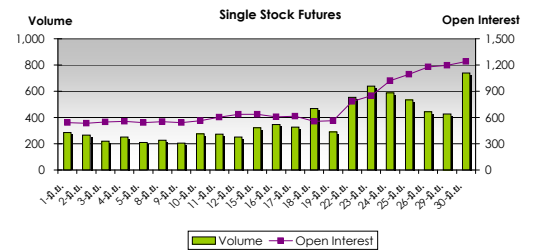
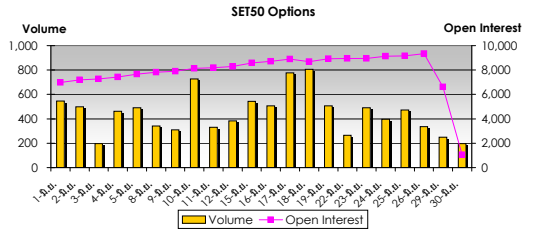
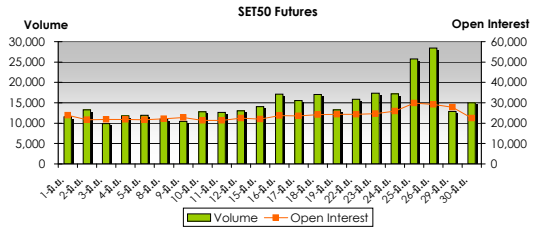
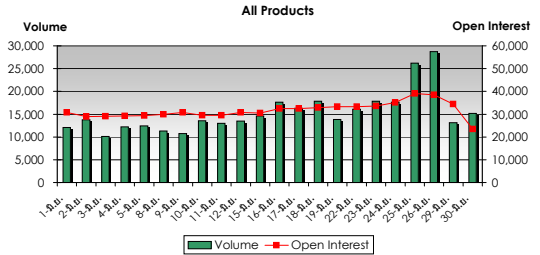
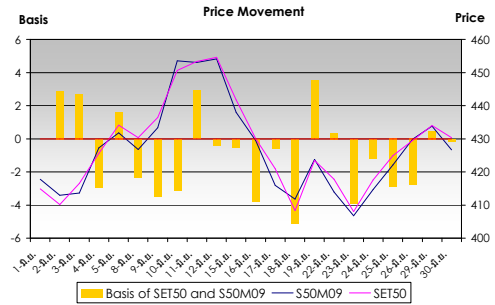
	Volume (Contracts)		Value (M.Baht)		Open Interest
	Average	Total	Average	Total	
SET50 Futures	14,905	327,907	6,329.11	139,240.41	22,385
SET50 Options	447	9,833	1.10	24.26	1,059
Call	247	5,429	0.69	15.07	601
Put	200	4,404	0.42	9.19	458
Total SET50 Index Market	15,352	337,740	6,330.21	139,264.67	23,444
ADVANCH Futures	53	1,161	4.54	99.97	244
BANPU Futures	0	4	0.06	1.29	2
BAY Futures	6	127	0.08	1.82	90
BBL Futures	0	3	0.01	0.31	2
ITD Futures	8	173	0.02	0.50	38
KBANK Futures	4	88	0.26	5.75	13
KTB Futures	36	787	0.30	6.58	395
LH Futures	12	274	0.06	1.40	102
PITTEP Futures	220	4,850	29.84	656.57	231
PIT Futures	18	392	4.20	92.43	21
QH Futures	1	21	0.00	0.03	9
SCB Futures	0	7	0.02	0.52	3
SCC Futures	1	19	0.13	2.78	10
TTA Futures	11	236	0.23	5.08	82
Total Stock Market	370	8,142	39.77	875.02	1,242
Gold Futures	821	18,053	635.19	13,974.22	1,853
Total Gold Market	821	18,053	635.19	13,974.22	1,853
Total All Market	16,542	363,935	7,005.18	154,113.91	26,539

Series Comparison

สัญญาที่มีการซื้อขายมากที่สุดในเดือนนี้ สำหรับ SET50 Index Futures ได้แก่ S50M09 ขณะที่ SET50 Call Options ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ S50M09C430, Put Options ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ S50M09P420 โดยมีอัตรา Put/Call ratio อยู่ที่ประมาณ 0.81 เท่า สำหรับ Stock Futures ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ PITTEPM09X และ Gold Futures สัญญา GFM09 เป็นสัญญาที่มีการซื้อขายมากที่สุด

	Volume		Open Interest	
	Contracts	%	Contracts	%
SET50 Index Futures				
S50M09	230,126	70.18	-	-
S50U09	95,851	29.23	21,799	97.38
S50Z09	1,625	0.50	490	2.19
S50H10	305	0.09	96	0.43
S50M10	-	-	-	-
Total SET50 Futures	327,907	100.00	22,385	100.00
SET50 Index Call Options (Most Active)				
S50M09C430	1,136	20.92	-	-
S50M09C440	601	11.07	-	-
S50M09C450	587	10.81	-	-
Total SET50 Call Options	5,429	100.00	601	100.00
SET50 Index Put Options (Most Active)				
S50M09P420	878	19.94	-	-
S50M09P410	653	14.83	-	-
S50M09P400	545	12.38	-	-
Total SET50 Put Options	4,404	100.00	458	100.00
Single Stock Futures (Most Active)				
PITTEPM09X	3,964	48.69	-	-
PITTEPU09X	884	10.86	230	18.52
ADVANC M09	800	9.83	-	-
Total Single Stock Futures	8,142	100.00	1,242	100.00
Gold Futures				
GFM09	11,672	64.65	-	-
GFO09	5,972	33.08	1,723	9.54
GFV09	402	2.23	123	0.68
GFZ09	7	0.04	7	0.04
Total Gold Futures	18,053	100.00	1,853	100.00

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, TFEX and its affiliates assume no responsibility for any error

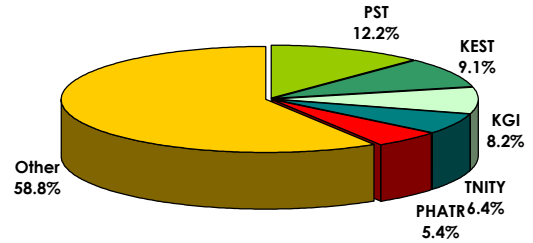


Broker Rank

บล. ฟิลลิป มีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด ตามด้วย บล. กิมเ็ง บล. เคจีไอ บล. ทรินิตี้ และบล. ภัทร ตามลำดับ โดยสมาชิกที่มีการซื้อขายสูงสุด 5 อันดับแรกมีการซื้อขายรวมกัน คิดเป็น 41.2% ของตลาด

ทั้งนี้ บล. กิมเ็ง มีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุดในช่วงครึ่งปีแรกของปี โดยมีสัดส่วนการซื้อขายรวม คิดเป็น 11.0% ตามด้วย บล. ฟิลลิป และบล. เคจีไอ คิดเป็น 10.5% และ 8.7% ตามลำดับ

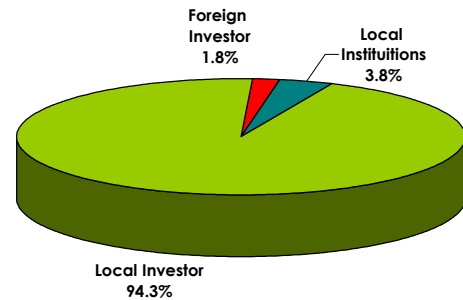
Top 10 Active Brokers			
Rank	Broker	Volume	%
1	PST	88,848	12.2
2	KEST	65,957	9.1
3	KGI	59,405	8.2
4	TNITY	46,303	6.4
5	PHATR	39,165	5.4
6	TNS	30,094	4.1
7	GBS	26,349	3.6
8	KKS	26,145	3.6
9	ASP	25,499	3.5
10	BLS	25,287	3.5



No. of Account Opened

ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนของจำนวนการเปิดบัญชีซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 94.3% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 3.8% และ 1.8% ตามลำดับ

	Jun-09	May-09	Change
Local Institutions	872	845	27
Local Investor	21,372	19,725	1,647
Foreign Investor	415	397	18
Total	22,659	20,967	1,692



Investor Type

ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 56.5% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ คิดเป็น 28.7% และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 14.9% ซึ่งมีสัดส่วนใกล้เคียงกับปริมาณการซื้อขายในช่วงครึ่งปีแรกของปี ที่ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขาย คิดเป็น 57.0% ผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 28.5% และ 14.5% ตามลำดับ

	Volume		
	Buy	Sell	Total
Local Institutions	103,942	104,784	208,726
Local Investor	204,828	206,161	410,989
Foreign Investor	55,165	52,990	108,155

