

Price Movement

ดัชนี SET50 เคลื่อนไหวค่อนข้างผันผวนในแดนบวกสลับแดนลบ ซึ่งเป็นไปในทิศทางเดียวกับตลาดหุ้นต่างประเทศ โดยส่วนหนึ่งมาจากปัจจัยภายในประเทศ อาทิเช่น ค่าบาทบาท และการชุมนุมของกลุ่มคนเสื้อแดง นอกจากนี้ ปัจจัยภายนอกประเทศ เรื่องปัญหาหนี้สินของบริษัทในดูไบในช่วงปลายเดือนก็เป็นอีกปัจจัยหนึ่งที่ยังคงสร้างความวิตกกังวลต่อการลงทุน ส่งผลให้ดัชนีปรับลดช่วงลงมา

SET50 ปรับตัวลดลงเล็กน้อยจากเดือนก่อน 0.13 จุด หรือ -0.03% ขณะที่ S50Z09 (Nearest series) ปรับตัวเพิ่มขึ้นเล็กน้อยจากเดือนก่อน 4.70 จุด หรือ 0.99% ซึ่งยังคงสอดคล้องกับทิศทางของ SET50

	High	Low	Settlement Price	Change (points)	Change %
SET50	508.09	469.50	483.54	-0.13	-0.03
S50Z09	508.50	461.60	481.10	4.70	0.99
S50H10	507.80	460.80	478.00	2.20	0.46
S50M10	504.40	459.90	477.00	1.50	0.32
S50J10	500.00	460.00	476.00	-0.10	-0.02

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

Trading Statistics

ตลาดอนุพันธ์มีปริมาณการซื้อขายในเดือนพ.ย. รวมทั้งสิ้น 350,043 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 185,843.28 ล้านบาท ปริมาณการซื้อขายส่วนใหญ่เป็นของ SET50 Index Futures คิดเป็น 66.27% ของทั้งหมด โดยมีการซื้อขายทั้งสิ้นเท่ากับ 231,965 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 112,331.88 ล้านบาท SET50 Index Options มีการซื้อขาย 12,999 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 37.02 ล้านบาท Single Stock Futures มีการซื้อขาย 24,409 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 838.44 ล้านบาท และ Gold Futures มีการซื้อขาย 80,670 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 72,635.94 ล้านบาท

ทั้งนี้ ปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในเดือนพฤศจิกายนเท่ากับ 16,669 สัญญา หรือคิดเป็นมูลค่า 8,849.68 ล้านบาท เพิ่มขึ้นเท่ากับ 657 สัญญา หรือเพิ่มขึ้นเท่ากับ 1,217.10 ล้านบาท เมื่อเทียบกับเดือนก่อนหน้า และปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในช่วง 11 เดือนแรกเท่ากับ 12,562 สัญญา หรือคิดเป็นมูลค่า 5,318.96 ล้านบาท

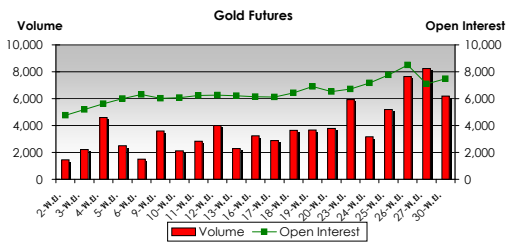
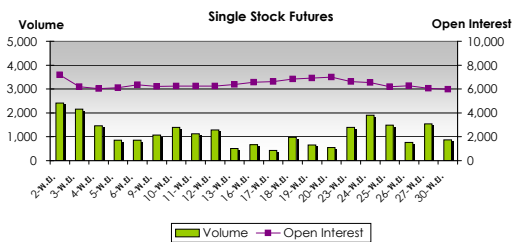
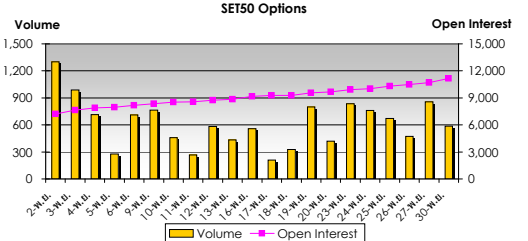
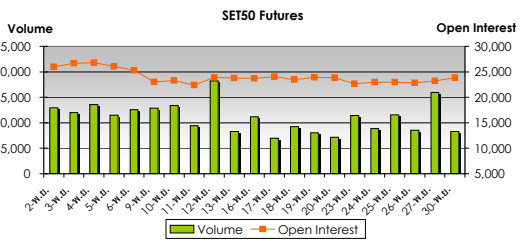
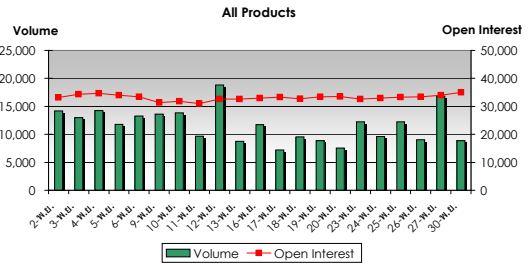
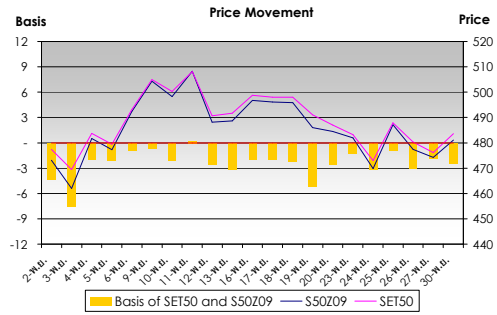
	Volume (Contracts)		Value (M.Baht)		Open Interest
	Average	Total	Average	Total	
SET50 Futures	11,046	231,965	5,349.14	112,331.88	23,824
SET50 Options	619	12,999	1.76	37.02	11,162
Call	293	6,153	0.54	11.40	5,876
Put	326	6,846	1.22	25.62	5,286
Total SET50 Index Market	11,665	244,964	5,350.90	112,368.90	34,986
ADVANCH Futures	19	389	1.57	33.07	198
BANPU Futures	1	23	0.54	11.42	20
BAY Futures	20	420	0.39	8.14	118
BBL Futures	-	-	-	-	-
ITD Futures	190	4,000	0.58	12.27	2,410
KBANK Futures	2	46	0.18	3.75	20
KTB Futures	333	6,988	3.07	64.45	1,124
LH Futures	90	1,880	0.54	11.32	315
PITTEP Futures	170	3,560	22.93	481.43	391
PTT Futures	12	257	2.83	59.44	42
QH Futures	90	1,885	0.22	4.61	444
SCB Futures	0	1	0.00	0.08	1
SCC Futures	3	55	0.56	11.76	32
TTA Futures	234	4,905	6.51	136.69	871
Total Stock Market	1,162	24,409	39.93	838.44	5,986
Gold Futures	3,841	80,670	3,458.85	72,635.94	7,472
Total Gold Market	3,841	80,670	3,458.85	72,635.94	7,472
Total All Market	16,669	350,043	8,849.68	185,843.28	48,444

Series Comparison

สัญญาที่มีการซื้อขายมากที่สุดในเดือนนี้ สำหรับ SET50 Index Futures ได้แก่ S50Z09 ขณะที่ SET50 Call Options ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ S50Z09C490, Put Options ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ S50Z09P480 โดยมีอัตรา Put/Call ratio อยู่ที่ประมาณ 1.11 เท่า สำหรับ Stock Futures ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ KTBZ09 และ Gold Futures สัญญา GFZ09 เป็นสัญญาที่มีการซื้อขายมากที่สุด

	Volume		Open Interest	
	Contracts	%	Contracts	%
SET50 Index Futures				
S50Z09	212,762	91.72	21,219	89.07
S50H10	17,628	7.60	1,769	7.43
S50M10	1,386	0.60	738	3.10
S50J10	189	0.08	98	0.41
Total SET50 Futures	231,965	100.00	23,824	100.00
SET50 Index Call Options (Most Active)				
S50Z09C490	1,117	18.15	599	10.19
S50Z09C500	1,008	16.38	727	12.37
S50Z09C510	948	15.41	575	9.79
Total SET50 Call Options	6,153	100.00	5,876	100.00
SET50 Index Put Options (Most Active)				
S50Z09P480	1,420	20.74	764	14.45
S50Z09P450	1,291	18.86	523	9.89
S50Z09P460	1,006	14.69	730	13.81
Total SET50 Put Options	6,846	100.00	5,286	100.00
Single Stock Futures (Most Active)				
KTBZ09	6,988	28.63	1,124	18.78
TTAZ09	4,856	19.89	821	13.72
ITDZ09	3,900	15.98	2,201	36.77
Total Single Stock Futures	24,409	100.00	5,986	100.00
Gold Futures				
GFZ09	57,362	71.11	4,600	61.56
GFG10	21,412	26.54	2,471	33.07
GFI10	1,896	2.35	401	5.37
Total Gold Futures	80,670	100.00	7,472	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

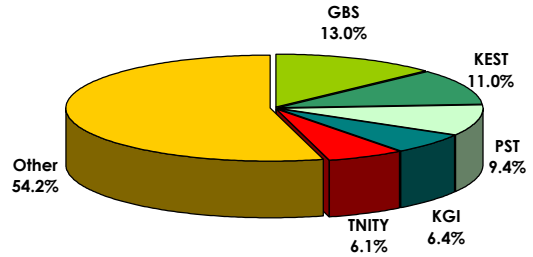


Broker Rank

บล. โกลเบล็ก มีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด ตามด้วย บล.กิมเอ็ง บล. ฟิลลิป บล. เคจีไอ และ บล.ทริเน็ต ตามลำดับ โดยสมาชิกที่มีการซื้อขายสูงสุด 5 อันดับแรกมีการซื้อขายรวมกัน คิดเป็น 45.8% ของตลาด

ทั้งนี้ บล. กิมเอ็ง มีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุดในช่วง 11 เดือนแรกของปี โดยมีสัดส่วนการซื้อขายรวม คิดเป็น 10.8% ตามด้วย บล.ฟิลลิป และบล.เคจีไอ คิดเป็น 10.0% และ 8.1% ตามลำดับ

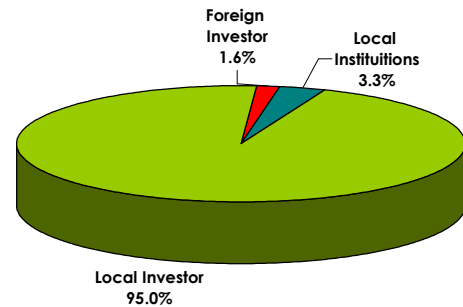
Top 10 Active Brokers			
Rank	Broker	Volume	%
1	GBS	91,057	13.0
2	KEST	76,729	11.0
3	PST	65,873	9.4
4	KGI	44,563	6.4
5	TNITY	42,442	6.1
6	ASP	25,228	3.6
7	KTZ	24,577	3.5
8	TNS	24,401	3.5
9	PHATR	23,143	3.3
10	SCIBS	21,794	3.1



No. of Account Opened

ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนของจำนวนการเปิดบัญชีซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 95.0% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 3.3% และ 1.6% ตามลำดับ

	Nov-09	Oct-09	Change
Local Institutions	955	938	17
Local Investor	27,097	25,540	1,557
Foreign Investor	465	454	11
Total	28,517	26,932	1,585



Investor Type

ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 62.8% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ คิดเป็น 30.4% และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 6.8% ซึ่งมีสัดส่วนใกล้เคียงกับปริมาณการซื้อขายในช่วง 11 เดือนแรกของปี ที่ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขาย คิดเป็น 61.0% ผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 28.1% และ 10.9% ตามลำดับ

	Volume		
	Buy	Sell	Total
Local Institutions	107,442	105,426	212,868
Local Investor	219,221	220,378	439,599
Foreign Investor	23,380	24,239	47,619

