

Price Movement

ดัชนี SET50 ปรับตัวเพิ่มขึ้นค่อนข้างแรงต่อเนื่องตลอดเดือน โดยปัจจัยหลักคือน้ำมันที่ปรับตัวขึ้นจากกระแสเงินทุนไหลเข้ามาในภูมิภาคเอเชีย และตลาดหุ้นไทย ซึ่งสืบเนื่องมาจากปัญหาหนี้สินของยุโรปและการฟื้นตัวของเศรษฐกิจสหรัฐที่ยังไม่แข็งแกร่ง ทำให้การเติบโตของเศรษฐกิจในภูมิภาคเอเชียเป็นแหล่งที่น่าสนใจลงทุน

SET50 ปรับตัวเพิ่มขึ้นจากเดือนก่อน 51.75 จุด หรือ 8.31% ขณะที่ S50Z10 (Nearest series) ปรับตัวเพิ่มขึ้นจากเดือนก่อน 56.50 จุด หรือ 9.10% ซึ่งสอดคล้องกับทิศทางของ SET50

	High	Low	Settlement Price	Change (points)	Change %
SET50	674.42	628.47	674.42	51.75	8.31
S50U10	671.90	617.00	668.92	47.52	7.65
S50Z10	679.20	617.00	677.20	56.50	9.10
S50H11	677.40	613.40	675.40	58.70	9.52
S50M11	676.60	613.50	674.00	56.40	9.13
S50U11	673.80	671.60	673.50	-	-

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

Trading Statistics

ตลาดอนุพันธ์มีปริมาณการซื้อขายในเดือนก.ย. รวมทั้งสิ้น 539,491 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 246,885.57 ล้านบาท ปริมาณการซื้อขายส่วนใหญ่เป็นของ SET50 Index Futures คิดเป็น 50.72% ของทั้งหมด โดยมีการซื้อขายทั้งสิ้นเท่ากับ 273,654 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 176,875.58 ล้านบาท SET50 Index Options มีการซื้อขาย 10,257 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 31.60 ล้านบาท Single Stock Futures มีการซื้อขาย 165,197 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 2,669.48 ล้านบาท และ Gold Futures มีการซื้อขาย 90,383 สัญญา คิดเป็นมูลค่า 67,308.91 ล้านบาท

ทั้งนี้ ปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในเดือนกันยายนเท่ากับ 24,522 สัญญา หรือคิดเป็นมูลค่า 11,222.07 ล้านบาท เพิ่มขึ้นเท่ากับ 8,706 สัญญา หรือเท่ากับ 3,572.94 ล้านบาท เมื่อเทียบกับเดือนก่อนหน้า และปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในช่วง 9 เดือนแรกของปีเท่ากับ 16,989 สัญญา หรือคิดเป็นมูลค่า 8,510.00 ล้านบาท

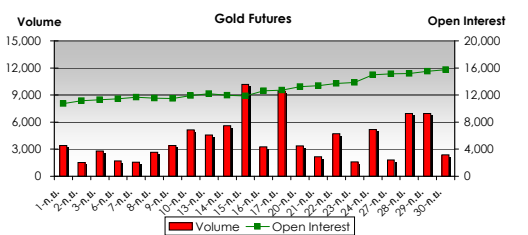
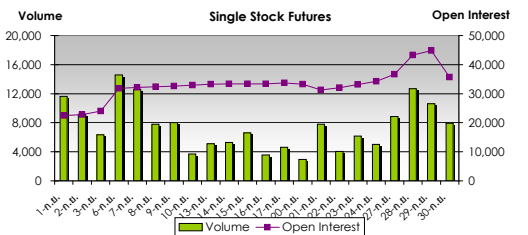
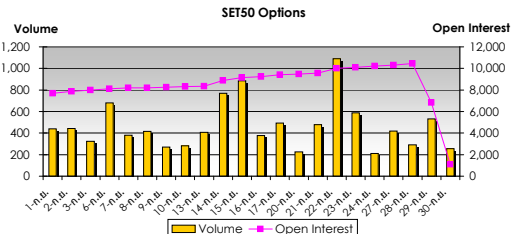
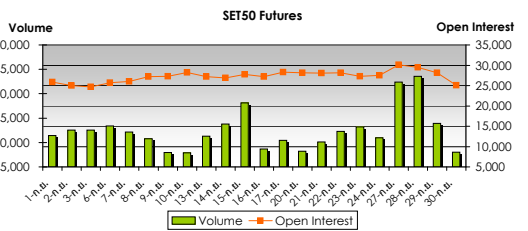
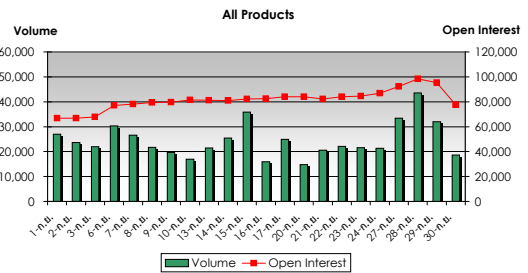
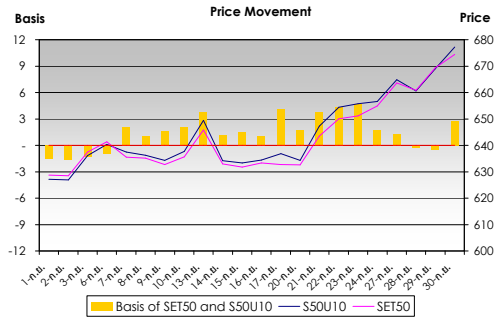
	Volume (Contracts)		Value (M.Baht)		Open Interest
	Average	Total	Average	Total	
SET50 Futures	12,439	273,654	8,039.80	176,875.58	25,075
SET50 Options	466	10,257	1.44	31.60	1,086
Call	300	6,602	1.18	25.95	663
Put	166	3,655	0.26	5.65	423
<b>Total SET50 Index Market</b>	<b>12,905</b>	<b>283,911</b>	<b>8,041.24</b>	<b>176,907.18</b>	<b>26,161</b>
ADVANC Futures	13	281	1.26	27.80	33
BANPU Futures	21	472	14.38	316.30	152
BAY Futures	26	571	0.59	12.93	88
BBL Futures	5	107	0.74	16.18	420
ITD Futures	1,575	34,642	6.80	149.53	13,947
KBANK Futures	3	61	0.31	6.80	19
KTB Futures	4,620	101,633	70.96	1,561.18	6,967
LH Futures	607	13,351	4.18	92.02	7,392
PTTEP Futures	70	1,540	10.32	227.02	265
PTT Futures	18	405	5.26	115.81	44
QH Futures	374	8,218	1.00	21.91	5,706
SCB Futures	3	73	0.33	7.32	25
SCC Futures	3	70	1.02	22.45	17
TTA Futures	172	3,773	4.19	92.22	627
<b>Total Stock Market</b>	<b>3,609</b>	<b>165,197</b>	<b>121.34</b>	<b>2,669.48</b>	<b>35,702</b>
Gold Futures	4,108	90,383	3,059.50	67,308.91	15,738
<b>Total Gold Market</b>	<b>4,108</b>	<b>90,383</b>	<b>3,059.50</b>	<b>67,308.91</b>	<b>15,738</b>
<b>Total All Market</b>	<b>20,622</b>	<b>539,491</b>	<b>11,222.07</b>	<b>246,885.57</b>	<b>77,601</b>

Series Comparison

สัญญาที่มีการซื้อขายมากที่สุดในเดือนนี้ สำหรับ SET50 Index Futures ได้แก่ S50U10 ขณะที่ SET50 Call Options ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ S50U10C640, Put Options ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ S50U10P560 โดยมีอัตรา Put/Call ratio อยู่ที่ประมาณ 0.55 เท่า สำหรับ Stock Futures ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ KTBU10 และ Gold Futures สัญญา GFV10 เป็นสัญญาที่มีการซื้อขายมากที่สุด

	Volume		Open Interest	
	Contracts	%	Contracts	%
<b>SET50 Index Futures</b>				
S50U10	181,002	66.14	-	-
S50Z10	89,660	32.76	24,121	96.20
S50H11	2,584	0.94	807	3.22
S50M11	395	0.14	139	0.55
S50U11	13	0.00	8	0.03
<b>Total SET50 Futures</b>	<b>273,654</b>	<b>100.00</b>	<b>25,075</b>	<b>100.00</b>
<b>SET50 Index Call Options (Most Active)</b>				
S50U10C640	1,820	27.57	-	-
S50U10C650	777	11.77	-	-
S50U10C660	726	11.00	-	-
<b>Total SET50 Call Options</b>	<b>6,602</b>	<b>100.00</b>	<b>663</b>	<b>100.00</b>
<b>SET50 Index Put Options (Most Active)</b>				
S50U10P560	519	14.20	-	-
S50U10P630	493	13.49	-	-
S50U10P620	480	13.13	-	-
<b>Total SET50 Put Options</b>	<b>3,655</b>	<b>100.00</b>	<b>423</b>	<b>100.00</b>
<b>Single Stock Futures (Most Active)</b>				
KTBU10	69,314	41.96	-	-
KTBZ10	32,158	19.47	6,862	19.22
ITDZ10	22,529	13.64	13,947	39.07
<b>Total Single Stock Futures</b>	<b>165,197</b>	<b>100.00</b>	<b>35,702</b>	<b>100.00</b>
<b>Gold Futures</b>				
GFV10	39,755	43.99	5,971	37.94
GFZ10	20,793	23.01	4,370	27.77
GF10V10	14,809	16.38	2,146	13.64
<b>Total Gold Futures</b>	<b>90,383</b>	<b>100.00</b>	<b>15,738</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, TFEX and its affiliates assume no responsibility for any error

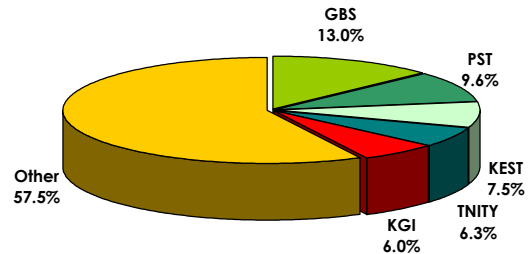


## Broker Rank

บล. โกลเบล็ก มีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด ตามด้วย บล. ฟิลลิป บล.กิมเฮ็ง บล.ทรีดีดี และ บล.เคจีไอ ตามลำดับ โดยสมาชิกที่มีการซื้อขายสูงสุด 5 อันดับแรกมีการซื้อขายรวมกัน คิดเป็น 42.5% ของตลาด

ทั้งนี้ บล. โกลเบล็ก มีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุดในช่วง 9 เดือนแรกของปี โดยมีสัดส่วนการซื้อขายรวม คิดเป็น 12.9% ตามด้วย บล. ฟิลลิป และบล.กิมเฮ็ง คิดเป็น 8.7% และ 8.3% ตามลำดับ

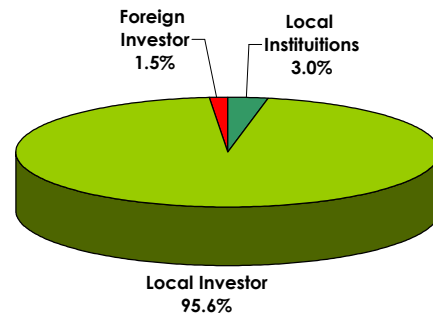
Top 10 Active Brokers			
Rank	Broker	Volume	%
1	GBS	140,008	13.0
2	PST	104,032	9.6
3	KEST	81,279	7.5
4	TNITY	68,459	6.3
5	KGI	64,533	6.0
6	PHATR	63,969	5.9
7	KTZ	43,769	4.1
8	BLS	40,709	3.8
9	ASP	37,108	3.4
10	MTSGF	32,054	3.0



## No. of Account Opened

ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนของจำนวนการเปิดบัญชีซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 95.5% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 3.0% และ 1.5% ตามลำดับ

	Sep-10	Aug-10	Change
Local Institutions	1,134	1,119	15
Local Investor	36,555	35,699	856
Foreign Investor	563	554	9
<b>Total</b>	<b>38,252</b>	<b>37,372</b>	<b>880</b>



## Investor Type

ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 55.7% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ คิดเป็น 32.9% และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 11.4% ซึ่งมีสัดส่วนใกล้เคียงกับปริมาณการซื้อขายในช่วง 9 เดือนแรกของปี ที่ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขาย คิดเป็น 56.9% ผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 32.6% และ 10.5% ตามลำดับ

	Volume		
	Buy	Sell	Total
Local Institutions	172,709	182,497	355,206
Local Investor	300,170	301,290	601,460
Foreign Investor	66,612	55,704	122,316

