

Price Movement

ดัชนี SET50 เคลื่อนไหวค่อนข้างผันผวนตลอดทั้งเดือน เนื่องจากนักลงทุนมีความกังวลจากทั้งจากปัจจัยภายในประเทศ เรื่องกรณีแยบพรคประชาชียปิด และจากปัจจัยภายนอกประเทศ อาทิ มาตรการในการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยของจีน ปัญหาความขัดแย้งในคาบสมุทรเกาหลี และปัญหาหนี้สาธารณะในยุโรป ซึ่งเป็นปัจจัยสำคัญที่กดดันตลาด

SET50 ปรับตัวเพิ่มขึ้นจากเดือนก่อน 20.94 จุด หรือ 3.09% ขณะที่ S50Z10 (Nearest series) ปรับตัวเพิ่มขึ้นจากเดือนก่อน 23.10 จุด หรือ 3.42% ซึ่งสอดคล้องกับทิศทางของ SET50

	High	Low	Settlement Price	Change (points)	Change %
SET50	733.22	687.51	698.46	20.94	3.09
S50Z10	735.70	680.00	698.60	23.10	3.42
S50H11	735.30	680.00	697.40	22.50	3.33
S50M11	734.10	679.00	696.20	21.70	3.22
S50U11	734.00	680.40	699.00	26.80	3.99

*** Change : เปลี่ยนที่หน่วยบาท/หน่วยตรา Settlement price ของ SET50 และ SET50 Index Futures ของเดือนก่อนหน้า

Trading Statistics

ตลาดอนุพันธ์มีปริมาณการซื้อขายในเดือนพ.ย. รวมทั้งสิ้น 559,904 สัญญา โดยปริมาณการซื้อขายส่วนใหญ่เป็นของ SET50 Index Futures คิดเป็น 45.44% ของทั้งตลาด โดยมีการซื้อขายทั้งสิ้นเท่ากับ 254,396 สัญญา SET50 Index Options มีการซื้อขาย 7,767 สัญญา Single Stock Futures มีการซื้อขาย 155,969 สัญญา Gold Futures มีการซื้อขาย 141,757 สัญญา และ Interest Rate Futures มีการซื้อขาย 15 สัญญา

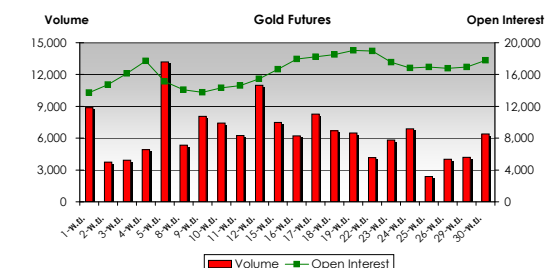
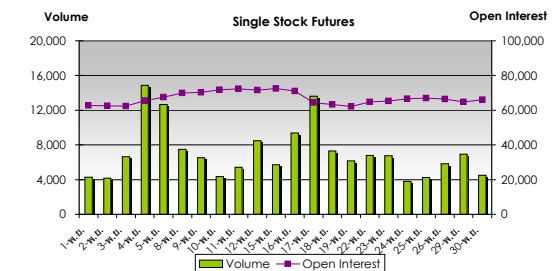
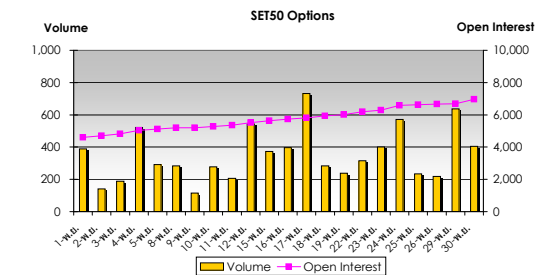
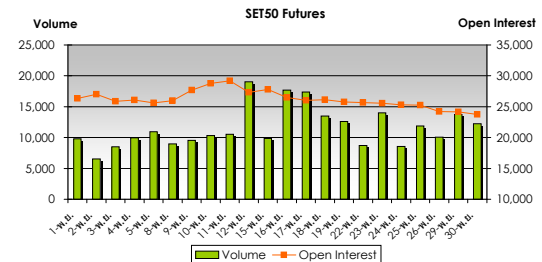
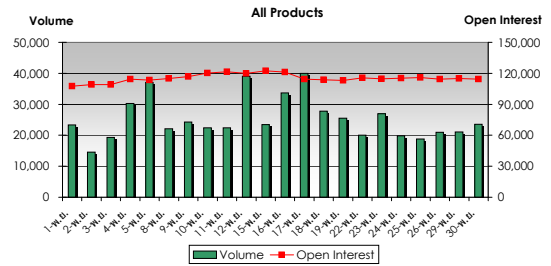
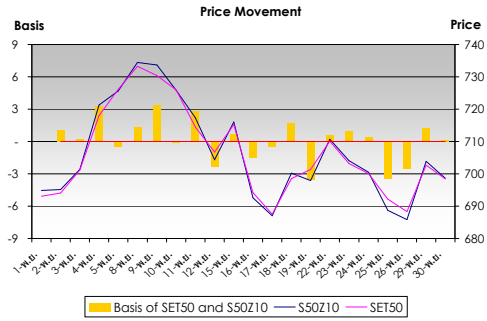
ทั้งนี้ ปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในเดือนพฤศจิกายนเท่ากับ 25,450 สัญญา เพิ่มขึ้นเท่ากับ 2,088 สัญญา เมื่อเทียบกับเดือนก่อนหน้า และปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในช่วง 11 เดือนของปีเท่ากับ 18,403 สัญญา

	Volume (Contracts)		Open Interest
	Average	Total	
SET50 Futures	11,563	254,396	23,770
SET50 Options	353	7,767	6,962
Call	192	4,219	3,724
Put	161	3,548	3,238
Total SET50 Index Market	11,916	262,163	30,732
ADVANC Futures	68	1,498	446
BANPU Futures	44	960	361
BAY Futures	25	557	292
BBL Futures	56	1,232	1,502
ITD Futures	2,903	63,861	23,914
KBANK Futures	10	216	51
KTB Futures	2,752	60,539	11,393
LH Futures	242	5,321	2,045
PTTEP Futures	146	3,206	973
PIT Futures	30	655	290
QH Futures	647	14,237	22,386
SCB Futures	4	83	45
SCC Futures	5	118	60
TIA Futures	158	3,486	2,218
Total Stock Market	7,090	155,969	65,976
Gold Futures	6,444	141,757	17,769
Total Gold Market	6,444	141,757	17,769
Interest Rate Futures	1	15	9
Total Interest Rate Market	1	15	9
Total All Market	25,450	559,904	114,486

Series Comparison

สัญญาที่มีการซื้อขายมากที่สุดในเดือนนี้ สำหรับ SET50 Index Futures ได้แก่ S50Z10 ขณะที่ SET50 Call Options ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ S50Z10C700, Put Options ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ S50Z10P690 โดยมีอัตรา Put/Call ratio อยู่ที่ประมาณ 0.84 เท่า สำหรับ Single Stock Futures, Gold Futures และ Interest Rate Futures สัญญาที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ ITDZ10, GFZ10 และ TGB5Z10 ตามลำดับ

	Volume		Open Interest	
	Contracts	%	Contracts	%
SET50 Index Futures				
S50Z10	224,060	88.08	19,298	81.19
S50H11	28,298	11.12	3,778	15.89
S50M11	1,538	0.60	447	1.88
S50U11	500	0.20	247	1.04
Total SET50 Futures	254,396	100.00	23,770	100.00
SET50 Index Call Options (Most Active)				
S50Z10C700	712	16.88	517	0.14
S50Z10C730	585	13.87	253	0.07
S50Z10C720	582	13.79	334	0.09
Total SET50 Call Options	4,219	100.00	3,724	100.00
SET50 Index Put Options (Most Active)				
S50Z10P690	697	19.64	408	0.13
S50Z10P680	453	12.77	301	0.09
S50Z10P630	440	12.40	133	0.04
Total SET50 Put Options	3,548	100.00	3,238	100.00
Single Stock Futures (Most Active)				
ITDZ10	61,661	39.53	22,985	34.84
KTBZ10	57,355	36.77	10,788	16.35
QHZ10	10,260	6.58	19,271	29.21
Total Single Stock Futures	155,969	100.00	65,976	100.00
Gold Futures				
GFZ10	54,894	38.72	4,651	26.17
GF10Z10	32,707	23.07	3,357	18.89
GFG11	28,762	20.29	4,696	26.43
Total Gold Futures	141,757	100.00	17,769	100.00
Interest Rate Futures				
TGB5Z10	15	100.00	9	100.00
Total Interest Rate Futures	15	0.01	9	100.00

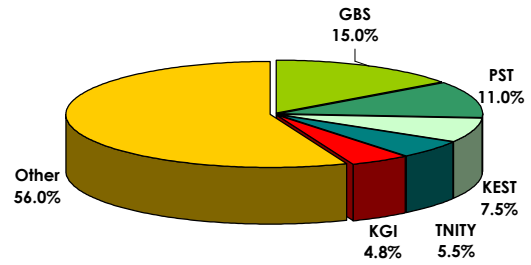


Broker Rank

บล. โกลเบล็ก มีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด ตามด้วย บล. ฟิลลิป บล.กิมเฮ็ง บล.ทรีดีดี และบล.เคจีไอ ตามลำดับ โดยสมาชิกที่มีการซื้อขายสูงสุด 5 อันดับแรกมีการซื้อขายรวมกัน คิดเป็น 44.0% ของตลาด

ทั้งนี้ บล. โกลเบล็ก มีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุดในช่วง 11 เดือนของปี โดยมีสัดส่วนการซื้อขายรวม คิดเป็น 13.4% ตามด้วย บล. ฟิลลิป และบล.กิมเฮ็ง คิดเป็น 9.3% และ 8.0% ตามลำดับ

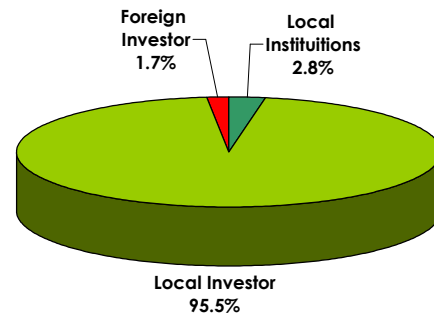
Top 10 Active Brokers			
Rank	Broker	Volume	%
1	GBS	168,293	15.0
2	PST	125,167	11.2
3	KEST	83,714	7.5
4	TNITY	62,083	5.5
5	KGI	53,345	4.8
6	KTZ	50,256	4.5
7	MTSGF	46,432	4.2
8	AFC	41,289	3.7
9	FSS	40,075	3.6
10	CGS	38,229	3.4



No. of Account Opened

ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนของจำนวนการเปิดบัญชีซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 95.5% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 2.8% และ 1.7% ตามลำดับ

	Nov-10	Oct-10	Change
Local Institutions	1,142	1,148	-6
Local Investor	38,821	37,431	1,390
Foreign Investor	701	647	54
Total	40,664	39,226	1,438



Investor Type

ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 60.8% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ คิดเป็น 32.7% และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 6.5% ซึ่งมีสัดส่วนใกล้เคียงกับปริมาณการซื้อขายในช่วง 11 เดือนของปี ที่ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขาย คิดเป็น 57.6% ผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 32.8% และ 9.6% ตามลำดับ

	Volume		
	Buy	Sell	Total
Local Institutions	180,999	185,387	366,386
Local Investor	339,330	341,416	680,746
Foreign Investor	39,575	33,101	72,676

