

Price Movement

ดัชนี SET50 เคลื่อนไหวผันผวนแรงตลอดเดือน เป็นไปในทิศทางเดียวกับตลาดต่างประเทศ เนื่องจากตลาดหุ้นไทยได้รับแรงกดดันจากความกังวลเรื่องเศรษฐกิจโลก จากปัญหาเศรษฐกิจสหรัฐและหนี้ยุโรปที่อาจลุกลามบานปลายส่งผลให้เศรษฐกิจโลกชะงักงัน

SET50 ปรับตัวลดลงจากเดือนก่อน 93.39 จุด หรือ -12.80% ขณะที่ S50U11 (Nearest series) ปรับตัวลดลงจากเดือนก่อน 101.01 จุด หรือ -15.67% ซึ่งสอดคล้องกับทิศทางของ SET50

	High	Low	Settlement Price	Change (points)	Change %
SET50	747.06	629.14	636.30	-93.39	-12.80
S50U11	752.90	592.40	644.79	-101.01	-15.67
S50Z11	752.00	587.00	622.30	-122.50	-19.69
S50H12	752.00	588.00	621.50	-121.70	-19.58
S50M12	747.00	590.00	622.00	-120.60	-19.39
S50U12	649.00	622.00	627.20	-	-

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

Trading Statistics

ตลาดอนุพันธ์มีปริมาณการซื้อขายในเดือน ก.ย. รวมทั้งสิ้น 1,403,404 สัญญา โดยปริมาณการซื้อขายส่วนใหญ่เป็นของ Metal Futures คิดเป็น 46.9% ของทั้งหมด โดยมีการซื้อขายทั้งหมด 658,257 ตามด้วย สัญญา SET50 Index Futures มีการซื้อขาย 594,655 สัญญา สัญญา Single Stock Futures มีการซื้อขาย 139,136 สัญญา และ SET50 Index Options มีการซื้อขาย 11,356 ตามลำดับ

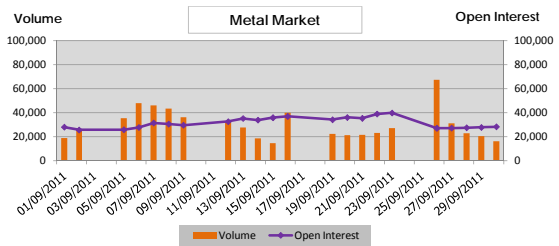
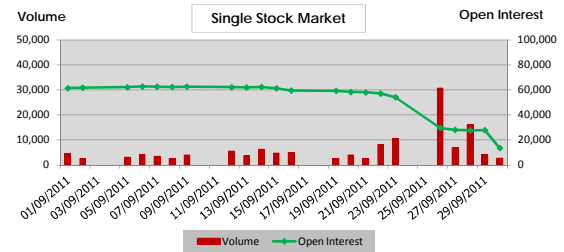
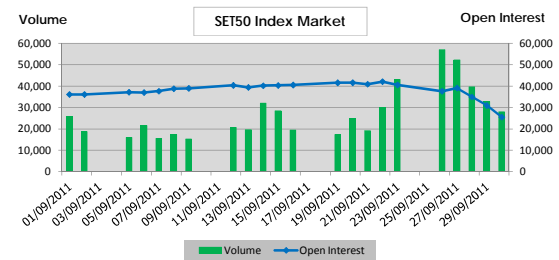
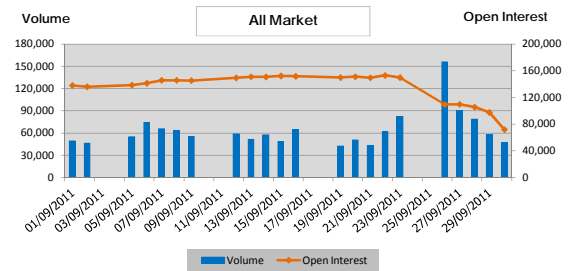
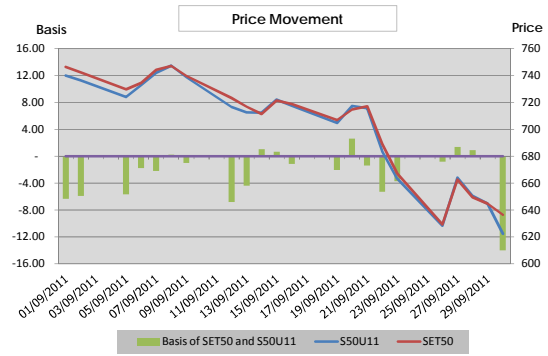
ทั้งนี้ ปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในเดือนกันยายนเท่ากับ 63,791 สัญญา ลดลง 11,025 สัญญา หรือเท่ากับ 14.74% เมื่อเทียบกับเดือนก่อนหน้า และปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อปี เท่ากับ 72,068 สัญญา

	Volume (Contracts)		Open Interest
	Average	Total	
SET50 Index Market	27,546	313,740	30,258
SET50 Futures	27,030	594,655	25,583
SET50 Options	516	11,356	4,675
Call	224	4,924	1,609
Put	292	6,432	3,066
Single Stock Market	6,324	139,136	13,496
Metal Market	29,921	658,257	28,301
- 50 Baht Gold Futures	12,458	274,069	11,860
- 10 Baht Gold Futures	17,259	379,695	15,294
- Silver Futures	204	4,493	1,147
Interest Rate Market	0	0	13
- 3M BIBOR	0	0	-
- 6M THBFX	0	0	-
- 5Y Gov. Bond	0	0	13
Total All Market	63,791	1,403,404	72,068

Series Comparison

สัญญาที่มีการซื้อขายมากที่สุดในเดือนนี้ สำหรับ SET50 Index Futures ได้แก่ S50U11 ขณะที่ SET50 Call Options ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ S50U11C730, Put Options ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ S50U11P700 โดยมีอัตรา Put/Call ratio อยู่ที่ประมาณ 1.31 เท่า สำหรับ Single Stock Futures, และ Metal Futures สัญญาที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ KTBU11 และ GF10V11 ตามลำดับ

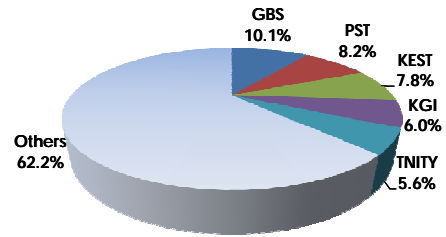
	Volume		Open Interest	
	Contracts	%	Contracts	%
SET50 Index Futures				
S50U11	370,552	62.31	-	-
S50Z11	215,149	36.18	24,277	94.90
S50H12	7,806	1.31	1,129	4.41
S50M12	1,112	0.19	170	0.66
S50U12	36	0.01	7	0.03
Total SET50 Futures	594,655	100.00	25,583	100.00
SET50 Index Call Options (Most Active)				
S50U11C730	526	10.68	-	-
S50U11C740	462	9.38	-	-
S50U11C750	449	9.12	-	-
Total SET50 Call Options	4,924	100.00	1,609	100.00
SET50 Index Put Options (Most Active)				
S50U11P700	712	11.07	-	-
S50U11P710	639	9.93	-	-
S50U11P720	614	9.55	-	-
Total SET50 Put Options	6,432	100.00	3,066	100.00
Single Stock Futures (Most Active)				
KTBU11	49,318	35.45	-	-
KTBY11	22,543	16.20	3,181	23.57
IRPCZ11	12,359	8.88	216	1.60
Total Single Stock Futures	139,136	100.00	13,496	100.00
Metal Futures (Most Active)				
GF10V11	243,155	36.94	7,160	25.30
GFV11	190,291	28.91	5,765	20.37
GF10Z11	122,978	18.68	6,697	23.66
Total Metal Futures	658,257	100.00	28,301	100.00
Interest Rate Futures				
BB3Z11	-	-	-	-
TBF6Z11	-	-	11	84.62
TGB5Z11	-	-	-	-
Total Interest Rate Futures	-	100.00	13	100.00



## Broker Rank

บล. โกลเบล็ก มีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุดตามด้วย บล. ฟิลลิป บล.กิมเิ่ง บล.เคจีไอ และบล. ทรินิตี้ ตามลำดับ โดยสมาชิกที่มีการซื้อขายสูงสุด 5 อันดับแรกมีการซื้อขายรวมกัน คิดเป็น 37.8% ของตลาด

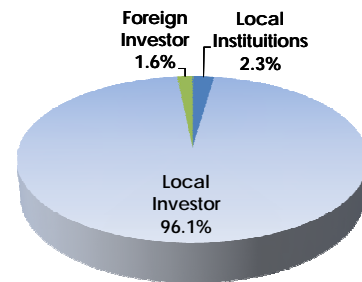
Top 10 Active Brokers			
Rank	Broker	Volume	%
1	GBS	284,602	10.14
2	PST	230,021	8.20
3	KEST	219,438	7.82
4	KGI	169,596	6.04
5	TNITY	156,528	5.58
6	FSS	153,531	5.47
7	MTSGF	138,320	4.93
8	GTWM	137,308	4.89
9	CGS	112,761	4.02
10	KTZ	107,769	3.84



## No. of Account Opened

ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนของจำนวนการเปิดบัญชีซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 96.1% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 2.3% และ 1.6% ตามลำดับ

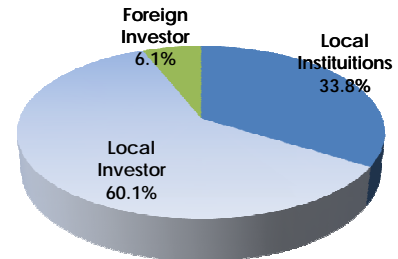
	Sep-11	Aug-11	Change
Local Institutions	1,345	1,320	25
Local Investor	56,878	53,640	3,238
Foreign Investor	950	911	39
<b>Total</b>	<b>59,173</b>	<b>55,871</b>	<b>3,302</b>



## Investor Type

ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 60.1% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ คิดเป็น 33.8% และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 6.1%

	Volume		
	Buy	Sell	Total
Local Institutions	490,500	458,280	948,780
Local Investor	828,432	859,629	1,688,061
Foreign Investor	84,472	85,495	169,967



**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.