

Price Movement

ดัชนี SET50 เคลื่อนไหวผันผวนแรงตลอดเดือน เป็นไปในทิศทางเดียวกับตลาดหุ้นต่างประเทศ เนื่องจากตลาดหุ้นไทยได้รับแรงกดดันจากภาวะกังวลเรื่องการแก้ไขปัญหาน้ำท่วมของยุโรป และสถานการณ์น้ำท่วมที่ยังอยู่ในขั้นวิกฤต

SET50 ปรับตัวเพิ่มขึ้นจากเดือนก่อน 55.67 จุด หรือ 9.30% ขณะที่ S50Z11 (Nearest series) ปรับตัวเพิ่มขึ้นจากเดือนก่อน 56.80 จุด หรือ 8.36% ซึ่งสอดคล้องกับทิศทางของ SET50

	High	Low	Settlement Price	Change (points)	Change %
SET50	691.99	592.57	691.97	55.67	9.30
S50Z11	689.70	571.00	679.10	56.80	8.36
S50H12	686.50	569.30	675.70	54.20	8.02
S50M12	685.10	572.90	675.00	53.00	7.85
S50U12	686.00	570.30	676.00	48.80	7.22

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

Trading Statistics

ตลาดอนุพันธ์มีปริมาณการซื้อขายในเดือน ต.ค. รวมทั้งสิ้น 1,007,998 สัญญา โดยปริมาณการซื้อขายส่วนใหญ่เป็นของ SET50 Index Futures คิดเป็น 58.8% ของทั้งตลาด โดยมีการซื้อขายทั้งสิ้นเท่ากับ 586,422 สัญญา ตามด้วย Metal Futures มีการซื้อขาย 288,823 สัญญา, Single Stock Futures มีการซื้อขาย 123,772 สัญญา, SET50 Index Options มีการซื้อขาย 6,353 สัญญา และ Oil Futures มีการซื้อขาย 2,628 สัญญา ตามลำดับ

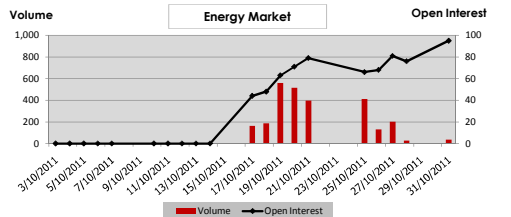
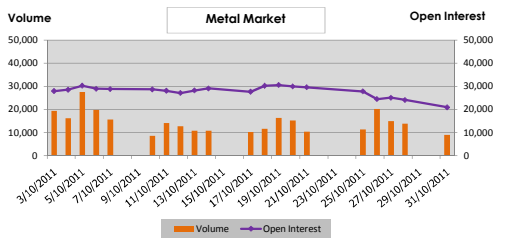
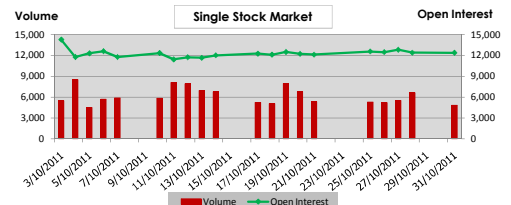
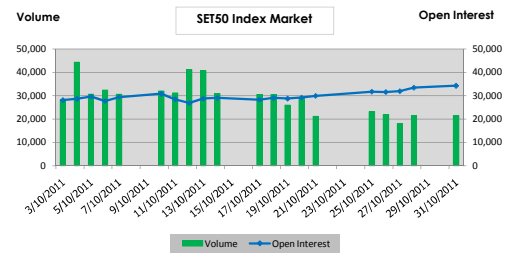
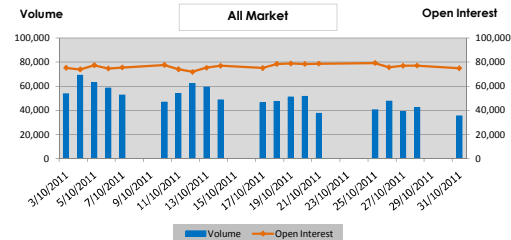
ทั้งนี้ ปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในเดือนตุลาคมเท่ากับ 50,531 สัญญา ลดลง 13,260 สัญญา หรือเท่ากับ 20.79% เมื่อเทียบกับเดือนก่อนหน้า และปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อปี เท่ากับ 42,718 สัญญา

	Volume (Contracts)		Open Interest
	Average	Total	
SET50 Index Market	29,639	592,775	41,445
SET50 Futures	29,321	586,422	34,287
SET50 Options	318	6,353	7,158
Call	164	3,275	2,903
Put	154	3,078	4,255
Single Stock Market	6,189	123,772	12,373
Metal Market	14,441	288,823	20,954
- 50 Baht Gold Futures	4,900	97,993	9,798
- 10 Baht Gold Futures	9,402	188,048	10,746
- Silver Futures	139	2,782	410
Energy Market	263	2,628	95
Interest Rate Market	0	0	13
- 3M BIBOR	0	0	-
- 6M THBFX	0	0	-
- 5Y Gov. Bond	0	0	13
Total All Market	50,531	1,007,998	74,880

Series Comparison

สัญญาที่มีการซื้อขายมากที่สุดในเดือนนี้ สำหรับ SET50 Index Futures ได้แก่ S50Z11 ขณะที่ SET50 Index Options ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ S50Z11C700 โดยมีอัตรา Put/Call ratio อยู่ที่ประมาณ 0.94 เท่า สำหรับ Single Stock Futures, Metal Futures และ Oil Futures สัญญาที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ KTBZ11, GF10V11 และ BRX11 ตามลำดับ

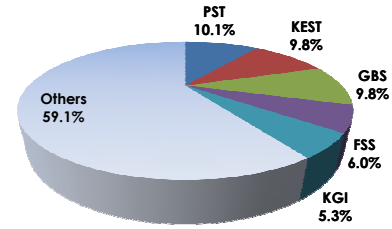
	Volume		Open Interest	
	Contracts	%	Contracts	%
SET50 Index Futures				
S50Z11	544,624	92.87	32,214	93.95
S50H12	38,477	6.56	1,734	5.06
S50M12	2,837	0.48	288	0.84
S50U12	484	0.08	51	0.15
Total SET50 Futures	586,422	100.00	34,287	100.00
SET50 Index Options (Most Active)				
S50Z11C700	399	6.28	252	3.52
S50Z11C740	393	6.19	481	6.72
S50Z11C650	353	5.56	292	4.08
Total SET50 Options	6,353	100.00	7,158	100.00
Single Stock Futures (Most Active)				
KTBZ11	102,990	83.21	3,873	31.28
KTBH12	5,364	4.33	664	5.36
TMBZ11	2,028	1.64	879	7.10
Total Single Stock Futures	123,772	100.00	12,383	100.00
Metal Futures (Most Active)				
GF10V11	92,016	31.86	-	-
GF10Z11	84,176	29.14	8,405	40.11
GFV11	51,752	17.92	-	-
Total Metal Futures	288,823	100.00	20,954	100.00
Oil Futures				
BRX11	2,556	97.26	76	80.00
BRZ11	72	2.74	19	20.00
BRF12	-	-	-	-
Total Oil Futures	2,628	100.00	95	100.00
Interest Rate Futures				
BB3H12	-	-	-	-
TBF6H12	-	-	2	100.00
TGB5H12	-	-	-	-
Total Interest Rate Futures	-	-	2	100.00



Broker Rank

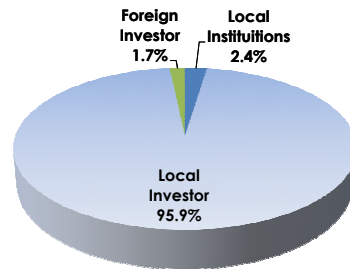
บล. ฟิลลิป มีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุดตามด้วย บล.กิมเิ่ง บล. โกลเบล็ก บล. ฟินันเซีย ไซรัส และ บล.เคจีไอ ตามลำดับ โดยสมาชิกที่มีการซื้อขาย สูงสุด 5 อันดับแรกมีการซื้อขายรวมกัน คิดเป็น 40.9% ของตลาด

Top 10 Active Brokers			
Rank	Broker	Volume	%
1	PST	202,701	10.05
2	KEST	198,294	9.84
3	GBS	196,996	9.77
4	FSS	120,220	5.96
5	KGI	106,178	5.27
6	TNITY	92,485	4.59
7	KTZ	90,900	4.51
8	CGS	90,675	4.50
9	BLS	88,799	4.40
10	ASP	79,254	3.93



No. of Account Opened

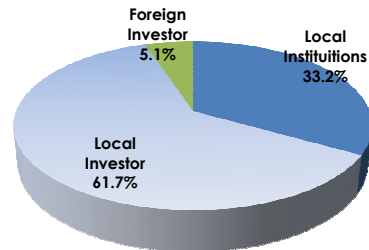
ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนของจำนวนการเปิดบัญชีซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 95.9% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 2.4% และ 1.7% ตามลำดับ



	Oct-11	Sep-11	Change
Local Institutions	1,466	1,345	121
Local Investor	58,698	56,878	1,820
Foreign Investor	1,014	950	64
Total	61,178	59,173	2,005

Investor Type

ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 61.7% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ คิดเป็น 33.2% และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 5.1%



	Volume		
	Buy	Sell	Total
Local Institutions	336,444	333,069	669,513
Local Investor	613,259	630,381	1,243,640
Foreign Investor	58,295	44,548	102,843