

Price Movement

ดัชนี SET50 เคลื่อนไหวในกรอบแคบตลอดเดือน ซึ่งเป็นไปในทิศทางเดียวกับตลาดหุ้นต่างประเทศ ท่ามกลางความกังวลที่มีต่อปัญหาหนี้ในยุโรป และเศรษฐกิจโลก ขณะที่ปัจจัยภายในประเทศ สถานการณ์น้ำมัน ยังส่งสัญญาณกดดันต่อการลงทุนในตลาดหุ้นไทย

SET50 ปรับตัวเพิ่มขึ้นจากเดือนก่อน 5.36 จุด หรือ 0.79% ขณะที่ S50Z11 (Nearest series) ปรับตัวเพิ่มขึ้นจากเดือนก่อน 14.10 จุด หรือ 2.03% ซึ่งสอดคล้องกับทิศทางของ SET50

	High	Low	Settlement Price	Change (points)	Change %
SET50	700.81	673.68	697.33	5.36	0.79
S50Z11	699.00	655.40	693.20	14.10	2.03
S50H12	695.00	652.60	686.30	10.60	1.54
S50M12	694.00	652.40	685.50	10.50	1.53
S50U12	693.90	652.40	685.00	9.00	1.31

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

Trading Statistics

ตลาดอนุพันธ์มีปริมาณการซื้อขายในเดือน พ.ย. รวมทั้งสิ้น 849,788 สัญญา โดยปริมาณการซื้อขายส่วนใหญ่เป็นของ SET50 Index Futures คิดเป็น 54.7% ของทั้งหมด โดยมีการซื้อขายทั้งสิ้นเท่ากับ 465,086 สัญญา ตามด้วย Metal Futures มีการซื้อขาย 283,602 สัญญา, Single Stock Futures มีการซื้อขาย 97,244 สัญญา, SET50 Index Options มีการซื้อขาย 3,270 สัญญา, Oil Futures มีการซื้อขาย 576 สัญญา และ Interest Rate Futures มีการซื้อขาย 10 สัญญา ตามลำดับ

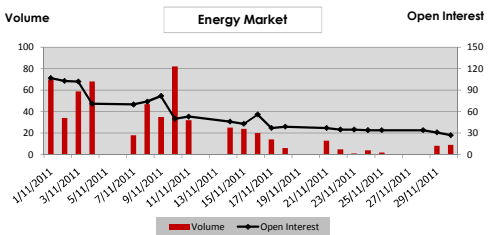
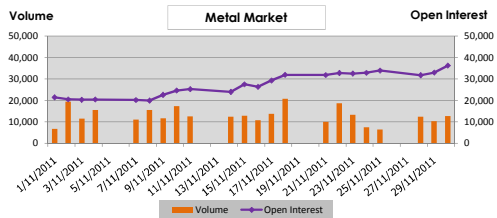
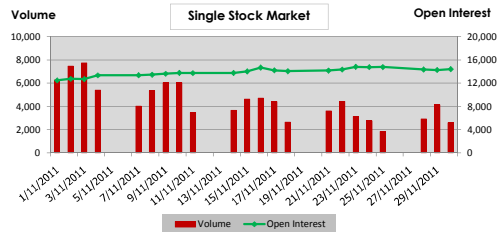
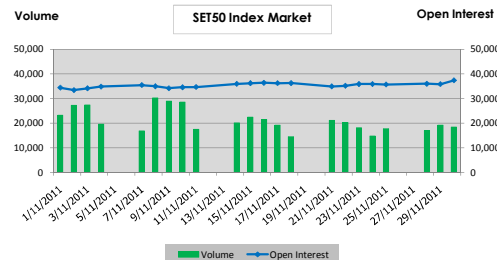
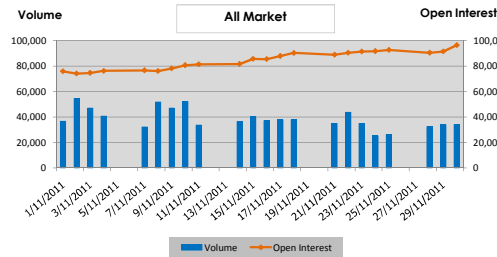
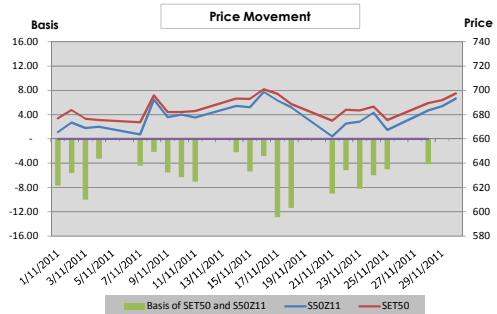
ทั้งนี้ ปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในเดือนพฤศจิกายนเท่ากับ 38,627 สัญญา ลดลง 11,904 สัญญา หรือเท่ากับ 23.6% เมื่อเทียบกับเดือนก่อนหน้า และปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อปี เท่ากับ 42,176 สัญญา

	Volume (Contracts)		Open Interest
	Average	Total	
SET50 Index Market	21,289	468,356	45,736
SET50 Futures	21,140	465,086	37,407
SET50 Options	149	3,270	8,329
Call	61	1,338	3,402
Put	88	1,932	4,927
Single Stock Market	4,420	97,244	14,420
Metal Market	12,891	283,602	36,218
- 50 Baht Gold Futures	4,632	101,901	15,229
- 10 Baht Gold Futures	8,229	181,031	20,445
- Silver Futures	30	670	544
Energy Market	26	576	27
Interest Rate Market	0	10	20
- 3M BIBOR	0	0	-
- 6M THBFX	0	0	-
- 5Y Gov. Bond	0	10	20
Total All Market	38,627	849,788	96,421

Series Comparison

สัญญาที่มีการซื้อขายมากที่สุดในเดือนนี้ สำหรับ SET50 Index Futures ได้แก่ S50Z11 ขณะที่ SET50 Index Options ที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ S50Z11P660 โดยมีอัตรา Put/Call ratio อยู่ที่ประมาณ 1.44 เท่า สำหรับ Single Stock Futures, Metal Futures, Oil Futures และ Interest Rate Futures สัญญาที่มีการซื้อขายสูงสุดได้แก่ KTBZ11, GF10G12, BRX11 และ TBF6Z11 ตามลำดับ

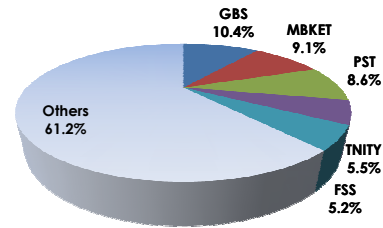
	Volume		Open Interest	
	Contracts	%	Contracts	%
SET50 Index Futures				
S50Z11	429,599	92.37	33,574	89.75
S50H12	31,888	6.86	3,134	8.38
S50M12	3,237	0.70	622	1.66
S50U12	362	0.08	77	0.21
Total SET50 Futures	465,086	100.00	37,407	100.00
SET50 Index Options (Most Active)				
S50Z11P660	312	9.54	154	1.85
S50Z11P650	240	7.34	274	3.29
S50Z11C690	226	6.91	106	1.27
Total SET50 Options	3,270	100.00	8,329	100.00
Single Stock Futures (Most Active)				
KTBZ11	82,630	84.97	5,023	34.83
KTBH12	5,669	5.83	1,157	8.02
IIDZ11	1,625	1.67	559	3.88
Total Single Stock Futures	97,244	100.00	14,420	100.00
Metal Futures (Most Active)				
GF10Z11	140,172	49.43	13,229	36.53
GFZ11	85,110	30.01	11,103	30.66
GF10G12	36,416	12.84	6,133	16.93
Total Metal Futures	283,602	100.00	36,218	100.00
Oil Futures				
BRX11	411	71.35	-	-
BRZ11	165	28.65	27	100.00
Total Oil Futures	576	100.00	27	100.00
Interest Rate Futures				
TBF6Z11	10	100.00	18	90.00
TBF6H12	-	-	2	10.00
Total Interest Rate Futures	10	100.00	20	100.00



Broker Rank

บล. โกลเบล็ก มีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด ตามด้วย บล.เมย์แบงก์ กิมเอ็ง บล. ฟิลลิป บล.ทรีดีดี และ บล.ฟินันเซีย ไซรัส ตามลำดับ โดยสมาชิกที่มีการซื้อขายสูงสุด 5 อันดับแรกมีการซื้อขายรวมกัน คิดเป็น 38.8% ของตลาด

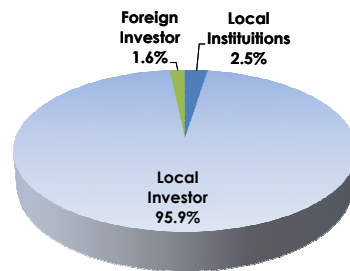
Top 10 Active Brokers			
Rank	Broker	Volume	%
1	GBS	176,334	10.38
2	MBKET	154,810	9.11
3	PST	146,225	8.60
4	TNITY	92,837	5.46
5	FSS	88,904	5.23
6	CGS	83,940	4.94
7	MTSGF	82,451	4.85
8	KGI	82,390	4.85
9	GTWM	79,247	4.66
10	ASP	76,267	4.49



No. of Account Opened

ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนของจำนวนการเปิดบัญชีซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 95.9% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 2.5% และ 1.6% ตามลำดับ

	Nov-11	Oct-11	Change
Local Institutions	1,544	1,466	78
Local Investor	59,595	58,698	897
Foreign Investor	1,023	1,014	9
Total	62,162	61,178	984



Investor Type

ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 59.1% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ คิดเป็น 35.7% และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 5.2%

	Volume		
	Buy	Sell	Total
Local Institutions	299,071	307,180	606,251
Local Investor	508,203	496,027	1,004,230
Foreign Investor	42,514	46,581	89,095

