

สรุปภาวะการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ปี 2560

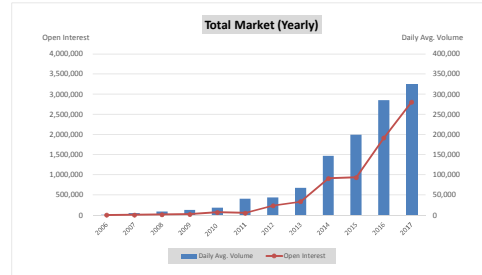
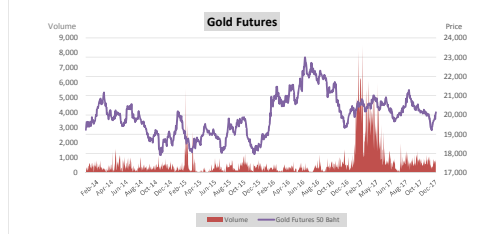
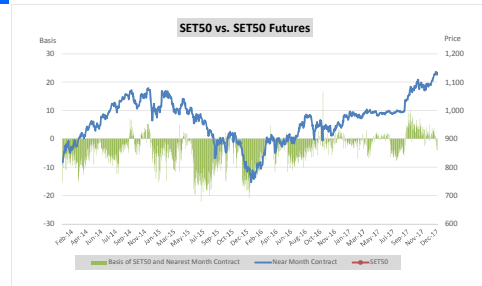


Market Overview

ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ในปี 2560 ปรับตัวเพิ่มขึ้นต่อเนื่องเป็นไปในทิศทางเดียวกับตลาดหุ้นต่างประเทศ เนื่องจากปัจจัยจากต่างประเทศ อาทิ ผลการประชุม ECB และ BOJ ที่คงอัตราดอกเบี้ย, แผนปฏิรูปภาษีของปธน.ทรัมป์ อีกทั้งความร่วมมือระหว่างจีนและเกาหลีใต้เพื่อแก้ไขปัญหาความสมุทรเกาหลี นอกจากนี้ตลาดยังได้รับปัจจัยบวกจากราคาน้ำมันดิบที่ปรับตัวเพิ่มขึ้นอย่างต่อเนื่อง จากการคาดการณ์ประเทศผู้ส่งออกน้ำมันอาจขยายเวลาปรับลดการผลิตน้ำมันไปจนถึงสิ้นปีหน้า ขณะที่ ปัจจัยภายในประเทศ ได้แก่ การพิจารณาเรื่องการเลือกตั้งในปี 60 การแก้ไขโรปรประกอบการณ์ Q4/60 และการปรับเพิ่มประมาณการ GDP ของรปท.

การเคลื่อนไหวของราคา SET50 Index Futures ในปี 2560 ปรับตัวเพิ่มขึ้น 169.60 จุด หรือคิดเป็น +17.64% เมื่อเทียบกับสิ้นปี 2559 ขณะที่ SET50 Index ปรับตัวเพิ่มขึ้น 170.30 จุด หรือคิดเป็น +17.65% โดยมีค่าสหสัมพันธ์ (Correlation) สูงถึง 0.99 และมีค่าเบสิส ระหว่าง SET50 Index Futures และ SET50 Index เคลื่อนไหวอยู่ระหว่าง -7.68 จุด ถึง 9.74 จุด

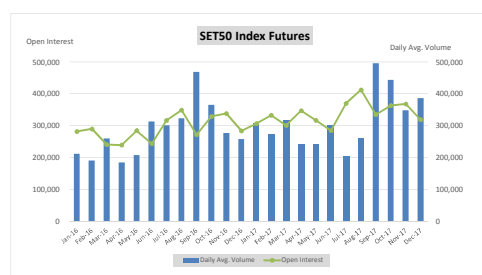
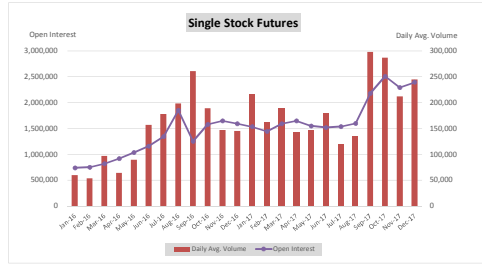
การเคลื่อนไหวของราคาทองคำแท่งในปี 2560 ราคาทองคำแท่งปรับตัวเพิ่มขึ้น 350 บาท คิดเป็น 1.77% เมื่อเทียบกับสิ้นปี 2559 โดยราคาทองคำแท่งเคลื่อนไหวในกรอบแคบ จากค่าเงินบาทที่แข็งค่าขึ้นต่อเนื่อง และจากปัจจัยภายนอกประเทศ อาทิ นโยบายของนายโดนัลด์ ทรัมป์ ผลการเลือกตั้งประธานาธิบดีฝรั่งเศส ความขัดแย้งระหว่างหลายประเทศ และความวิตกกังวลเกี่ยวกับสถานการณ์ตึงเครียดในความสมุทรเกาหลี โดยราคาทองคำแท่งในประเทศสูงสุดที่ราคา 20,950 บาทต่อทองคำ 1 บาท ในวันที่ 18 เมษายน 2560 และต่ำสุดที่ราคา 19,800 บาท ในวันที่ 27 มกราคม 2560



Trading Summary

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีปริมาณการซื้อขายในปี 2560 รวมทั้งสิ้น 78,990,574 สัญญา ซึ่งมีปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันเท่ากับ 324,217 สัญญา เพิ่มขึ้นจากปีก่อนร้อยละ 13.68 เมื่อเทียบกับปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในปี 2559 และมีจำนวนสถานะคงค้างทั้งสิ้น 2,813,036 สัญญา เพิ่มขึ้นจากปีก่อนร้อยละ 46.52

ปริมาณการซื้อขายรวมสูงที่สุดจำนวน 898,615 สัญญา ในวันที่ 24 มกราคม 2560 และปริมาณการซื้อขายต่ำที่สุดจำนวน 130,410 สัญญา ในวันที่ 25 สิงหาคม 2560



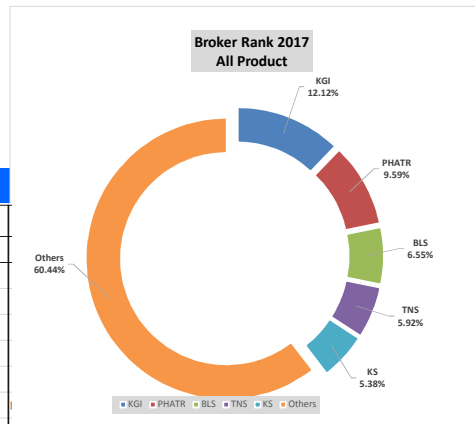
TFEX	2017		2016		%Change
	Average	Total	Average	Total	
Index Market	112,306	27,402,754	131,938	32,621,794	-14.88%
Metal Market	15,130	3,691,785	11,901	2,903,950	27.13%
Single Stock Market	194,593	47,480,762	138,634	33,826,624	40.37%
Currency Market	1,422	346,890	838	204,470	69.65%
Agricultural Market	44	10,613	1	250	3617.95%
Gold-D	722	57,770	-	-	-

All Market	2017	2016	2015	2014	2013
Daily avg. volume	324,217	285,189	199,749	147,025	68,017
Total volume	78,990,574	69,576,164	48,538,899	36,021,150	16,664,126
Open Interest	2,813,036	1,919,913	941,492	918,187	340,778

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 or omissions, including any damage loss or claim arising from reliance on the information.

Broker Rank

บล.เคจีไอ มีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุดในปี 2560 คิดเป็น 12.12% ตามด้วย บล.ภัทร บล.บัวหลวง บล.ธนาชาด และบล.กสิกรไทย ตามลำดับ โดยสมาชิกทั้ง 5 รายยังคงเป็น รายเดิมกับปีก่อนหน้า เพียงแต่สลับตำแหน่ง



Top 10 Active Brokers

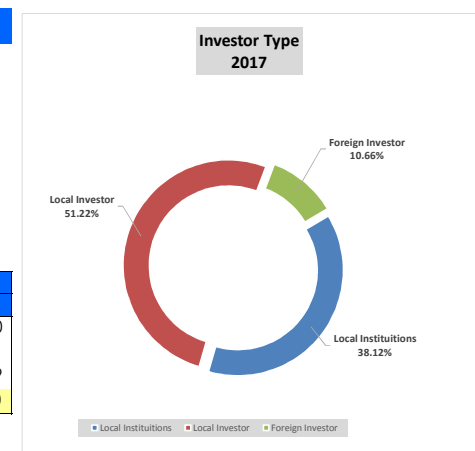
Rank	2017				2016			
	TFX*	%	SET**	%	TFX*	%	SET**	%
1	KGI	12.12	DBSV	6.77	KGI	12.59	MBKET	8.01
2	PHATR	9.59	MBKET	6.69	PHATR	10.09	CMBS	6.11
3	BLS	6.55	CMBS	5.59	TNS	6.11	FSS	5.54
4	TNS	5.92	PHATRA	4.90	KS	5.87	PHATRA	5.01
5	KS	5.38	FSS	4.84	BLS	4.81	BLS	4.48
6	KTBST	5.20	BLS	4.60	HGF	4.59	DBSV	4.37
7	JPM	5.12	SCBS	4.16	MBKET	4.58	CS	4.29
8	MBKET	4.85	CLSA	4.00	RHBS	4.40	TNS	4.18
9	PST	3.57	CS	3.85	JPM	3.71	KS	3.70
10	RHBS	3.52	TNS	3.78	KTBST	3.65	KGI	3.69

* TFX broker rank by volume (% of Contracts)

** SET broker rank by value (% of baht)

Investor Type

ปริมาณการซื้อขายในปี 2560 ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 51.22% ผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ คิดเป็น 38.12% และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 10.66% ตามลำดับ



Investor Type	%							
	2017	2016	2015	2014	2013	2012	2011	2010
Local Institutions	38.12	36.80	34.82	35.62	35.92	38.87	33.55	32.70
Local Investor	51.22	52.78	53.61	56.13	56.03	53.40	60.03	57.21
Foreign Investor	10.66	10.42	11.57	8.25	8.05	7.74	6.42	10.09
Total	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00

No. of Client Account

จำนวนการเปิดบัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ สิ้นเดือนเดือน ธ.ค.60 ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนของจำนวนการเปิดบัญชีซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 96.19% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ คิดเป็น 2.46% และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 1.35% ตามลำดับ

ทั้งนี้จำนวนบัญชีซื้อขายเพิ่มขึ้นจากปีก่อน 17,275 บัญชี คิดเป็นเพิ่มขึ้น 13.36% สำหรับจำนวนผู้ลงทุนที่มีบัญชีซื้อขาย TFX มีจำนวน 98,089 ราย เพิ่มขึ้นจากปีก่อน 11,327 ราย หรือคิดเป็นเพิ่มขึ้น 12.75%



	2017	2016	2015	2014	2013	2012	2011	2010
Local Institutions	3,604	3,283	2,517	1,975	1,811	1,712	1,487	1,166
Local Investor	140,982	124,148	109,295	97,330	84,633	72,133	58,230	39,562
Foreign Investor	1,973	1,853	1,763	1,345	1,249	1,119	1,005	714
Total	146,559	129,284	113,575	100,650	87,693	74,964	60,722	41,442

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, TFX and its affiliates assume no responsibility for any error or omissions, including any damage loss or claim arising from reliance on the information.

สรุปภาวะการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ปี 2560



ปริมาณและมูลค่าการซื้อขาย Futures & SET50 Index Options

	2017		2016		2015		2014		2013		2012	
	Total	% YoY	Total	% YoY	Total	% YoY	Total	% YoY	Total	% YoY	Total	% YoY
ปริมาณการซื้อขาย : สัญญา												
ปริมาณการซื้อขายรวม												
FUTURES	77,908,893	13%	69,147,354	43%	48,231,768	34%	35,912,295	116%	16,598,717	60%	10,403,870	5%
- SET50 Index Futures	26,321,073	-18%	32,192,984	20%	26,764,395	86%	14,403,574	153%	5,688,404	41%	4,034,459	-7%
- Sector Futures	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	191	-
- Single Stock Futures	47,480,762	40%	33,826,624	72%	19,708,113	0%	19,624,561	133%	8,415,967	288%	2,168,037	37%
- Metal Futures	3,691,785	27%	2,903,950	99%	1,461,536	-5%	1,541,704	-30%	2,208,505	-40%	3,657,195	-9%
- 10 Baht Gold	3,500,669	29%	2,721,773	105%	1,328,932	2%	1,303,151	-21%	1,655,381	-36%	2,597,235	20%
- 50 Baht Gold	191,116	5%	182,177	37%	132,604	-44%	238,544	-57%	551,887	-47%	1,045,370	-42%
- Silver	-	-	-	-	-	-	9	-99%	1,237	-92%	14,590	-54%
- Deferred Precious Metal	57,770	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- GOLD-D	57,770	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- USD Futures	346,890	70%	204,470	-25%	271,754	-12%	309,926	29%	239,345	-40%	396,138	-
- Brent Crude Oil	-	-	19,076	-27%	25,970	-20%	32,530	-30%	46,496	-69%	147,823	4353%
- Interest Rate Future:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	27	-94%
- Agriculture	10,613	-	250	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SET50 Index Options	1,081,681	152%	428,810	40%	307,131	182%	108,855	66%	65,409	21%	54,057	-50%
รวม	78,990,574		69,576,164	43%	48,538,899	35%	36,021,150	116%	16,664,126	59%	10,457,927	4%
ปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวัน												
FUTURES	319,784	13%	283,432	43%	198,485	35%	146,581	116%	67,750	55%	43,603	7%
- SET50 Index Futures	107,873	-18%	131,938	20%	110,142	87%	58,790	153%	23,218	41%	16,467	-7%
- Sector Futures	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	4	-
- Single Stock Futures	194,593	40%	138,634	71%	81,103	1%	80,100	133%	34,351	288%	8,849	37%
- Metal Futures	15,130	27%	11,901	98%	6,015	-4%	6,293	-30%	9,014	-40%	14,927	-9%
- 10 Baht Gold	14,347	29%	11,155	104%	5,469	3%	5,319	-21%	6,757	-36%	10,601	19%
- 50 Baht Gold	783	5%	747	37%	546	-44%	974	-57%	2,253	-47%	4,267	-43%
- Silver	-	-	-	-	-	-	0	-	5	-92%	60	-75%
- Deferred Precious Metal	722	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- GOLD-D	722	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- USD Futures	1,422	70%	838	-25%	1,118	-12%	1,265	29%	977	-64%	2,751	-
- Brent Crude Oil	-	-100%	119	12%	107	-20%	133	-30%	190	-69%	603	845%
- Interest Rate Future:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	-94%
- Agriculture	44	-	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SET50 Index Options	4,433	152%	1,757	39%	1,264	184%	444	66%	267	21%	221	-50%
รวม	324,217	14%	285,189	43%	199,749	36%	147,025	116%	68,017	55%	43,823	7%
Open Interest : สัญญา												
FUTURES	2,777,097	46%	1,906,331	104%	935,868	2%	914,644	170%	339,138	43%	237,412	328%
- SET50 Index Futures	318,464	12%	283,692	-2%	288,560	62%	177,704	374%	37,496	2%	36,920	65%
- Sector Futures	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	5	-
- Single Stock Futures	2,393,257	51%	1,589,464	158%	615,012	-13%	704,176	149%	282,282	83%	154,366	1523%
- Metal Futures	50,637	103%	24,958	36%	18,328	-8%	19,819	47%	13,485	-60%	33,312	41%
- 10 Baht Gold	47,953	118%	21,990	31%	16,754	13%	14,790	73%	8,530	-60%	21,326	45%
- 50 Baht Gold	2,684	-10%	2,968	89%	1,574	-69%	5,029	2%	4,949	-58%	11,803	37%
- Silver	-	-	-	-	-	-	-	-	6	-97%	183	-20%
- Deferred Precious Metal	1,068	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- GOLD-D	1,068	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- USD Futures	13,150	61%	8,180	-40%	13,584	9%	12,496	122%	5,622	-53%	12,065	-
- Brent Crude Oil	-	-	-	-	384	-14%	449	77%	253	-66%	744	8167%
- Interest Rate Future:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- Agriculture	521	-	37	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SET50 Index Options	35,939	165%	13,582	142%	5,624	59%	3,543	116%	1,640	5%	1,569	64%
รวม	2,813,036	47%	1,919,913	104%	941,492	3%	918,187	169%	340,778	43%	238,981	323%
จำนวนผู้ลงทุน : บัญชี***												
ผู้ลงทุนทั่วไป	140,982	14%	124,148	14%	109,295	12%	97,330	15%	84,633	17%	72,133	24%
ผู้ลงทุนสถาบัน	3,604	10%	3,283	30%	2,517	27%	1,975	9%	1,811	6%	1,712	15%
ผู้ลงทุนต่างประเทศ	1,973	6%	1,853	5%	1,763	31%	1,345	8%	1,249	12%	1,119	11%
รวม (จำนวนบัญชี)	146,559	13%	129,284	14%	113,575	13%	100,650	15%	87,693	17%	74,964	23%
สัดส่วนการซื้อขายผ่าน Internet												
% of Total Market	22.48%	-18.84%	27.70%	-10.09%	30.81%	11.91%	27.53%	-7.99%	29.92%	-6.32%	31.94%	9.01%
ปริมาณการซื้อขายของสมาชิก (Broker Rank) 5 อันดับแรก												
1 KGI (12.12%)			KGI (12.59%)		KGI (11.16%)		KGI (12.30%)		KGI (11.74%)		GBS (9.94%)	
2 PHATR (9.59%)			PHATR (10.09%)		PHATR (7.03%)		PHATR (9.93%)		CIMBS (9.67%)		MBKET (6.83%)	
3 BLS (6.55%)			TNS (6.11%)		HGF (6.62%)		KS (6.43%)		PHATR (9.16%)		PHATR (6.79%)	
4 TNS (5.92%)			KS (5.87%)		RHBS (5.45%)		KTZ (5.89%)		MBKET (6.59%)		PST (6.34%)	
5 KS (5.38%)			BLS (4.81%)		KS (5.33%)		MBKET (5.61%)		KTZ (5.34%)		KGI (5.97%)	

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 or omissions, including any damage loss or claim arising from reliance on the information.