

สรุปภาวะการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ปี 2561

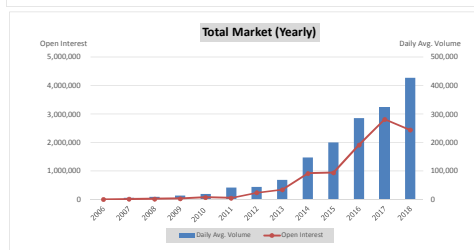
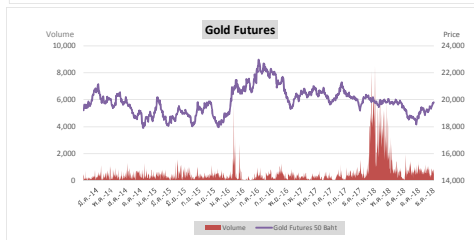
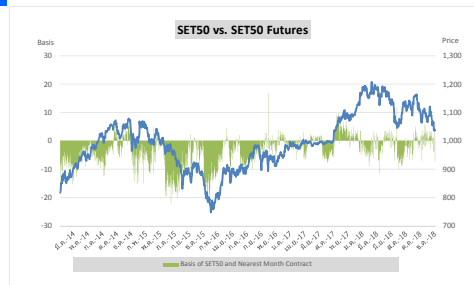


Market Overview

ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ในปี 2561 เคลื่อนไหวในแดนบวกสลับแดนลบ เป็นไปในทิศทางเดียวกับตลาดหุ้นต่างประเทศ เนื่องจากปัจจัยจากต่างประเทศ อาทิ FED ปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ย 0.25% การปิดหน่วยงานราชการของสหรัฐฯ ความกังวลสงครามการค้าจีน-สหรัฐฯ ความกังวลเงินไหลออกจากกลุ่มประเทศ Emerging Market อีกทั้งตลาดได้รับปัจจัยกดดันจากราคาน้ำมันที่ปรับตัวลดลง จากความกังวลต่ออุปทานน้ำมันดิบปรับตัวขึ้น ขณะที่ ปัจจัยภายในประเทศ ได้แก่ กบง.ปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ย 0.25% การปรับลด GDP ปี 61 จาก 4.4% เป็น 4.2%

การเคลื่อนไหวของราคา SET50 Index Futures ในปี 2561 ปรับตัวลดลง 96.90 จุด หรือคิดเป็น -8.57% เมื่อเทียบกับสิ้นปี 2560 ขณะที่ SET50 Index ปรับตัวลดลง 90.22 จุด หรือคิดเป็น -7.95% โดยมีค่าสหสัมพันธ์ (Correlation) สูงถึง 0.99 และมีค่าเบสิส ระหว่าง SET50 Index Futures และ SET50 Index เคลื่อนไหวอยู่ระหว่าง -11.62 จุด ถึง 11.86 จุด

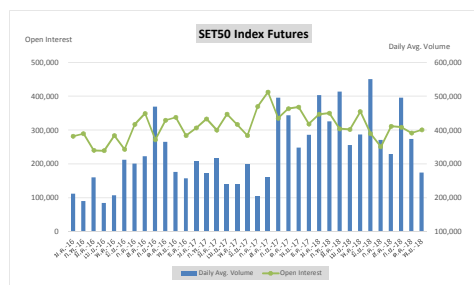
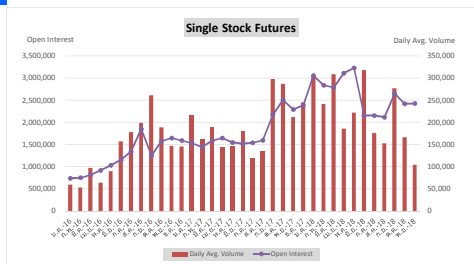
การเคลื่อนไหวของราคาทองคำแท่งในปี 2561 ราคาทองคำแท่งปรับตัวลดลง 350 บาท คิดเป็น -1.75% เมื่อเทียบกับสิ้นปี 2560 โดยราคาทองคำแท่งเคลื่อนไหวในกรอบแคบ จากค่าเงินบาทที่แข็งค่าขึ้นต่อเนื่อง และจากปัจจัยภายนอกประเทศ อาทิ ความวิตกกังวลว่าเฟดอาจจะปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายเร็วขึ้น โดยราคาทองคำแท่งในประเทศสูงสุดที่ราคา 20,300 บาทต่อทองคำ 1 บาท ในวันที่ 15 มกราคม 2561 และต่ำสุดที่ราคา 18,150 บาท ในวันที่ 1 ตุลาคม 2561



Trading Summary

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีปริมาณการซื้อขายในปี 2561 รวมทั้งสิ้น 104,422,200 สัญญา ซึ่งมีปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันเท่ากับ 426,213 สัญญา เพิ่มขึ้นจากปีก่อนร้อยละ 31.46 เมื่อเทียบกับปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในปี 2560 และมีจำนวนสถานะคงค้างทั้งสิ้น 2,440,223 สัญญา ลดลงจากปีก่อนร้อยละ 13.25

ปริมาณการซื้อขายรวมสูงที่สุดจำนวน 1,355,331 สัญญา ในวันที่ 27 มิถุนายน 2561 และปริมาณการซื้อขายต่ำที่สุดจำนวน 189,167 สัญญา ในวันที่ 28 พฤศจิกายน 2561



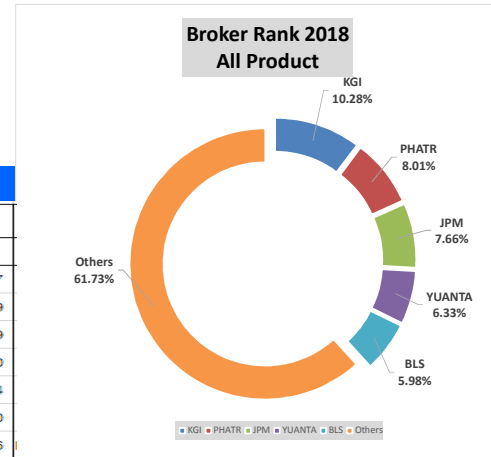
	2018		2017		%Change
	Average	Total	Average	Total	
TFEX	426,213	104,422,200	324,217	78,990,574	31.46%
Index Market	179,210	43,906,560	112,306	27,402,754	59.57%
Metal Market	17,781	4,356,424	15,130	3,691,785	17.52%
Single Stock Market	225,847	55,332,444	194,593	47,480,762	16.06%
Currency Market	2,799	685,847	1,422	346,890	96.91%
Agricultural Market	141	34,482	44	10,613	223.54%
Gold-D	434	106,443	722	57,770	-39.84%
Gold Online	2,327	88,411	-	-	-

	2018	2017	2016	2015	2014
All Market					
Daily avg. volume	426,213	324,217	285,189	199,749	147,025
Total volume	104,422,200	78,990,574	69,576,164	48,538,899	36,021,150
Open Interest	2,440,223	2,813,036	1,919,913	941,492	918,187

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 2561 คิดเป็น 10.28% ตามด้วย บล.ภัทร บล.เจพีมอร์แกน บล.หยวนต้า และบล.บัวหลวง ตามลำดับ โดยสมาชิกทั้ง 3 รายยังคงเป็นรายเดิมกับปีก่อนหน้า เพียงแต่สลับตำแหน่ง แต่มีสมาชิกราย บล.เจพีมอร์แกน และ บล.หยวนต้า ที่เพิ่มเข้ามา



Top 10 Active Brokers

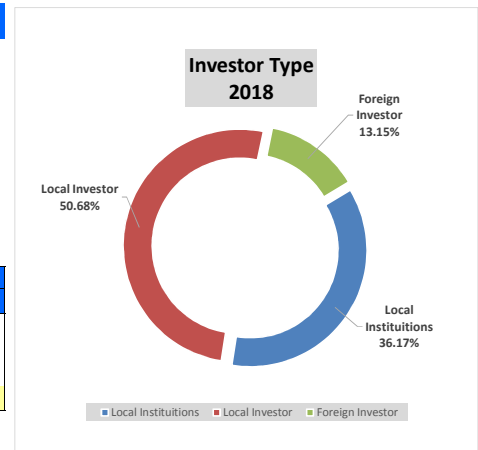
Rank	2018				2017			
	TFEX*	%	SET**	%	TFEX*	%	SET**	%
1	KGI	10.28	DBSV	6.81	KGI	12.12	DBSV	6.77
2	PHATR	8.01	MBKET	6.06	PHATR	9.59	MBKET	6.69
3	JPM	7.66	AWS	5.75	BLS	6.55	CIMBS	5.59
4	YUANTA	6.33	CLSA	5.37	TNS	5.92	PHATRA	4.90
5	BLS	5.98	CGS-CIMB	5.26	KS	5.38	FSS	4.84
6	KTBST	5.39	PHATRA	4.65	KTBST	5.20	BLS	4.60
7	PST	4.77	BLS	4.60	JPM	5.12	SCBS	4.16
8	CGS	4.63	CS	4.41	MBKET	4.85	CLSA	4.00
9	AWS	4.44	FSS	3.91	PST	3.57	CS	3.85
10	KS	4.43	YUANTA	3.84	RHBS	3.52	TNS	3.78

* TFEX broker rank by volume (% of Contracts)

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

Investor Type

ปริมาณการซื้อขายในปี 2561 ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 50.68% ผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ คิดเป็น 36.17% และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 13.15% ตามลำดับ

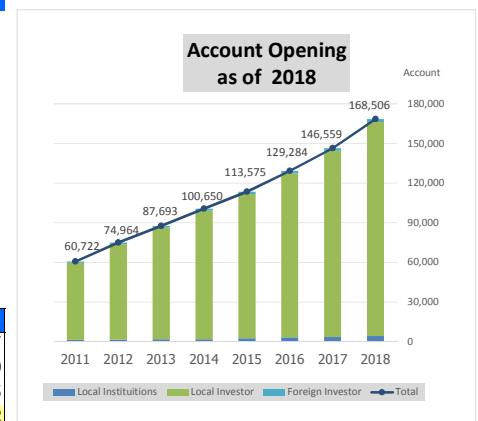


Investor Type	%							
	2018	2017	2016	2015	2014	2013	2012	2011
Local Institutions	36.17	38.11	36.80	34.82	35.62	35.92	38.87	33.55
Local Investor	50.68	51.22	52.78	53.61	56.13	56.03	53.40	60.03
Foreign Investor	13.15	10.67	10.42	11.57	8.25	8.05	7.74	6.42
Total	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00

No. of Client Account

จำนวนการเปิดบัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ สิ้นปี 2561 ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนของจำนวนการเปิดบัญชีซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 96.26% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ คิดเป็น 2.52% และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 1.22% ตามลำดับ

ทั้งนี้จำนวนบัญชีซื้อขายเพิ่มขึ้นจากปีก่อน 21,947 บัญชี คิดเป็นเพิ่มขึ้น 14.97% สำหรับจำนวนผู้ลงทุนที่มีบัญชีซื้อขาย TFEX มีจำนวน 107,474 ราย เพิ่มขึ้นจากปีก่อน 12,878 ราย หรือคิดเป็นเพิ่มขึ้น 13.13%



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.

สรุปภาวะการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ปี 2561



ปริมาณและมูลค่าการซื้อขาย Futures & SET50 Index Options

	2018		2017		2016		2015		2014	
	Total	% YoY	Total	% YoY	Total	% YoY	Total	% YoY	Total	% YoY
ปริมาณการซื้อขาย : สัญญา										
ปริมาณการซื้อขายรวม										
FUTURES	103,059,680	32%	77,908,893	13%	69,147,354	43%	48,231,768	34%	35,912,295	116%
- SET50 Index Futures	42,544,040	62%	26,321,073	-18%	32,192,984	20%	26,764,395	86%	14,403,574	153%
- Sector Futures	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- Single Stock Futures	55,332,444	17%	47,480,762	40%	33,826,624	72%	19,708,113	0%	19,624,561	133%
- Metal Futures	4,356,424	18%	3,691,785	27%	2,903,950	99%	1,461,536	-5%	1,541,704	-30%
- 10 Baht Gold	4,102,613	17%	3,500,669	29%	2,721,773	105%	1,328,932	2%	1,303,151	-21%
- 50 Baht Gold	165,400	-13%	191,116	5%	182,177	37%	132,604	-44%	238,544	-57%
- Gold Online	88,411	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- Deferred Precious Metal	106,443	84%	57,770	-	-	-	-	-	-	-
- GOLD-D	106,443	84%	57,770	-	-	-	-	-	-	-
- USD Futures	685,847	98%	346,890	70%	204,470	-25%	271,754	-12%	309,926	29%
- Brent Crude Oil	-	-	-	-	19,076	-27%	25,970	-20%	32,530	-30%
- Interest Rate Futures	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- Agriculture	34,482	225%	10,613	-	250	-	-	-	-	-
SET50 Index Options	1,362,520	26%	1,081,681	152%	428,810	40%	307,131	182%	108,855	66%
รวม	104,422,200	31%	78,990,574	14%	69,576,164	43%	48,538,899	35%	36,021,150	116%
ปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวัน										
FUTURES	420,652	32%	319,784	13%	283,432	43%	198,485	35%	146,581	116%
- SET50 Index Futures	173,649	61%	107,873	-18%	131,938	20%	110,142	87%	58,790	153%
- Sector Futures	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- Single Stock Futures	225,847	16%	194,593	40%	138,634	71%	81,103	1%	80,100	133%
- Metal Futures	17,781	18%	15,130	27%	11,901	98%	6,015	-4%	6,293	-30%
- 10 Baht Gold	16,745	17%	14,347	29%	11,155	104%	5,469	3%	5,319	-21%
- 50 Baht Gold	675	-14%	783	5%	747	37%	546	-44%	974	-57%
- Gold Online	2,327	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- Deferred Precious Metal	434	-40%	722	-	-	-	-	-	-	-
- GOLD-D	434	-40%	722	-	-	-	-	-	-	-
- USD Futures	2,799	97%	1,422	70%	838	-25%	1,118	-12%	1,265	29%
- Brent Crude Oil	-	-	-	-100%	119	12%	107	-20%	133	-30%
- Interest Rate Futures	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- Agriculture	141	224%	44	-	1	-	-	-	-	-
SET50 Index Options	5,561	25%	4,433	152%	1,757	39%	1,264	184%	444	66%
รวม	426,213	31%	324,217	14%	285,189	43%	199,749	36%	147,025	116%
Open Interest : สัญญา										
FUTURES	2,421,784	-13%	2,777,097	46%	1,906,331	104%	935,868	2%	914,644	170%
- SET50 Index Futures	241,787	-24%	318,464	12%	283,692	-2%	288,560	62%	177,704	374%
- Sector Futures	-	-	-	0%	-	-	-	-	-	-
- Single Stock Futures	2,134,802	-11%	2,393,257	51%	1,589,464	158%	615,012	-13%	704,176	149%
- Metal Futures	26,020	-49%	50,637	103%	24,958	36%	18,328	-8%	19,819	47%
- 10 Baht Gold	21,793	-55%	47,953	118%	21,990	31%	16,754	13%	14,790	73%
- 50 Baht Gold	2,022	-25%	2,684	-10%	2,968	89%	1,574	-69%	5,029	2%
- Gold Online	2,205	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- Deferred Precious Metal	488	-54%	1,068	-	-	-	-	-	-	-
- GOLD-D	488	-54%	1,068	-	-	-	-	-	-	-
- USD Futures	18,627	42%	13,150	61%	8,180	-40%	13,584	9%	12,496	122%
- Brent Crude Oil	-	-	-	-	-	-	384	-14%	449	77%
- Interest Rate Futures	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- Agriculture	60	-88%	521	-	37	-	-	-	-	-
SET50 Index Options	18,439	-49%	35,939	165%	13,582	142%	5,624	59%	3,543	116%
รวม	2,440,223	-13%	2,813,036	47%	1,919,913	104%	941,492	3%	918,187	169%
จำนวนผู้ลงทุน : บัญชี***										
ผู้ลงทุนทั่วไป	162,197	15%	140,982	14%	124,148	14%	109,295	12%	97,330	15%
ผู้ลงทุนสถาบัน	4,252	18%	3,604	10%	3,283	30%	2,517	27%	1,975	9%
ผู้ลงทุนต่างประเทศ	2,057	4%	1,973	6%	1,853	5%	1,763	31%	1,345	8%
รวม (จำนวนบัญชี)	168,506	15%	146,559	13%	129,284	14%	113,575	13%	100,650	15%
สัดส่วนการซื้อขายผ่าน Internet										
% of Total Market	26.02%	16%	22.48%	-18.84%	27.70%	-10.09%	30.81%	11.91%	27.53%	-7.99%
ปริมาณการซื้อขายของสมาชิก (Broker Rank) 5 อันดับแรก										
1 KGI (10.28%)			KGI (12.12%)		KGI (12.59%)		KGI (11.16%)		KGI (12.30%)	
2 PHATR (8.01%)			PHATR (9.59%)		PHATR (10.09%)		PHATR (7.03%)		PHATR (9.93%)	
3 JPM (7.66%)			BLS (6.55%)		TNS (6.11%)		HGF (6.62%)		KS (6.43%)	
4 YUANTA (6.33%)			TNS (5.92%)		KS (5.87%)		RHBS (5.45%)		KTZ (5.89%)	
5 BLS (5.98%)			KS (5.38%)		BLS (4.81%)		KS (5.33%)		MBKET (5.61%)	

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.