

สรุปภาวะการซื้อขายของตลาดอนุพันธ์ ปี 2554

Market Overview

ดัชนีตลาดหลักทรัพย์เคลื่อนไหวค่อนข้างผันผวนปี 2554 ซึ่งเป็นไปในทิศทางเดียวกับตลาดหุ้นต่างประเทศ ท่ามกลางความกังวลที่มีต่อปัญหาหนี้ในยุโรป และเศรษฐกิจโลก และปัจจัยภายในประเทศ สถานการณ์น้ำท่วม ที่ส่งสัญญาณกดดันต่อบรรยากาศการลงทุนในตลาดหุ้นไทย

การเคลื่อนไหวของราคา SET50 Index Futures ในปี 2554 ปรับตัวลดลง 7.5 จุด หรือคิดเป็น -1.1% เมื่อเทียบกับสิ้นปี 2553 ขณะที่ SET50 Index ปรับตัวลดลง 1.8 จุด หรือคิดเป็น -0.3% โดยมีค่าสหสัมพันธ์ (Correlation) สูงถึง 0.99 และมีค่าเบี่ยงเบนระหว่าง SET50 Index Futures และ SET50 Index เคลื่อนไหวอยู่ระหว่าง -16.2 จุด ถึง 6.7 จุด

ขณะที่ ราคาทองคำ ในปี 2554 เคลื่อนไหวค่อนข้างผันผวน เนื่องจากการร่วงลงของตลาดหุ้นจากกระแสความวิตกกังวลเกี่ยวกับวิกฤตหนี้ในกลุ่มประเทศยุโรป ส่งผลให้เข้ามาถือครองทองคำเพื่อป้องกันความเสี่ยงมากขึ้น โดยราคาทองคำแห่งประเทศไทยทำสถิติสูงสุดที่ราคา 26,850 บาทต่อทองคำ 1 บาท ในวันที่ 6 กันยายน 2554

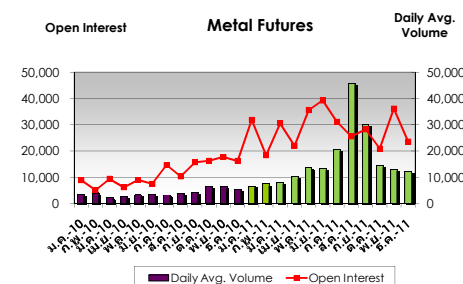
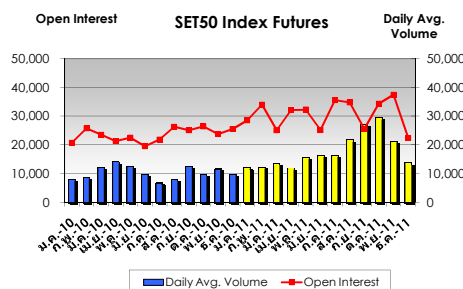
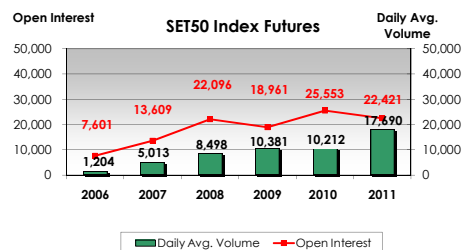
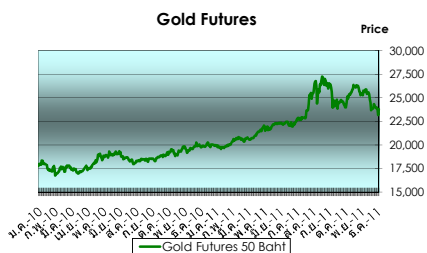
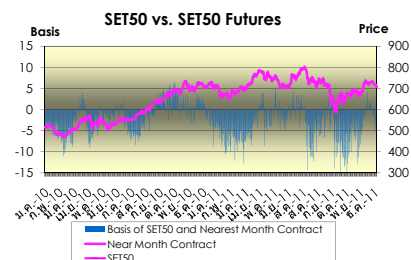
Trading Summary

ตลาดอนุพันธ์มีปริมาณการซื้อขายในปี 2554 รวมทั้งสิ้น 10,027,116 สัญญา ซึ่งมีปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันเท่ากับ 41,145 สัญญา หรือเพิ่มขึ้นร้อยละ 120.31 เมื่อเทียบกับปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในปี 2553 และมีจำนวนสถานะคงค้างทั้งสิ้น 56,452 สัญญา ลดลงจากปีก่อนร้อยละ 27.58

ปริมาณการซื้อขายรวมสูงที่สุดจำนวน 155,955 สัญญา ในวันที่ 26 กันยายน 2554 และปริมาณการซื้อขายต่ำที่สุดจำนวน 14,041 สัญญา ในวันที่ 18 มกราคม 2554

	2011		2010		%Change
	Average	Total	Average	Total	
TFEX	41,145	10,027,116	18,676	4,519,436	120.31%
SET50 Index Market	18,133	4,424,430	10,655	2,578,619	70.17%
Metal Market	16,479	4,020,845	4,014	971,423	310.52%
Single Stock Market	6,468	1,578,092	4,006	969,353	61.46%
Interest Rate Market	2	429	1	41	120.00%
Brent Crude Oil Market	64	3,320	-	-	-

	2011	2010	2009	2008	2007	2006
Daily avg. volume	41,145	18,676	12,771	8,837	5,219	1,204
Total volume	10,027,116	4,519,436	3,075,318	2,148,620	1,236,884	198,737
Open Interest	56,452	77,955	28,281	22,747	13,790	7,601



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.

สรุปภาวะการซื้อขายของตลาดอนุพันธ์ ปี 2554

Broker Rank

บล.โกลเบล็ก มีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุดในปี 2554 คิดเป็น 11.3% ตามด้วย บล.ฟิลลิป บล.เมย์แบงก์ กิมเอ็ง บ.เอ็มทีเอส และบล.เคจีไอ ตามลำดับ โดยสมาชิกที่มีการซื้อขายสูงสุด 4 อันดับแรกยังคงเป็นกลุ่มเดิมกับปีก่อนหน้า เพียงแต่สลับตำแหน่ง ยกเว้น บ.เอ็มทีเอส (สมาชิกประเภทตัวแทนที่จำกัดเฉพาะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิงกับโลหะมีค่า) เป็นสมาชิกรายใหม่ที่เพิ่มเข้ามาในช่วงเวลาดังกล่าว

Top 10 Active Brokers

Rank	2011				2010			
	TFEX*	%	SET**	%	TFEX*	%	SET**	%
1	GBS	11.28	MBKET	11.74	GBS	13.40	KEST	12.71
2	PST	8.44	FSS	5.10	PST	9.25	CGS	5.84
3	MBKET	7.40	CS	5.05	KEST	7.91	ASP	5.27
4	MTSGF	5.67	CGS	5.00	TNITY	6.10	KGI	4.64
5	KGI	5.42	UBS	4.93	KGI	5.64	PST	4.58
6	TNITY	5.15	PHATRA	4.86	PHATR	4.84	KTZ	4.58
7	FSS	4.28	ASP	4.85	KTZ	4.22	FSS	4.52
8	GTWM	4.26	BLS	4.79	ASP	3.91	TNS	4.51
9	CGS	4.16	KGI	4.52	MTSGF	3.24	BLS	4.37
10	AFC	4.07	TNS	4.42	CGS	3.23	PHATR	4.25

* TFEX broker rank by volume (% of Contracts)

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

Investor Type

ปริมาณการซื้อขายปี 2554 ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนการซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 60.0% ตามด้วย ผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ คิดเป็น 33.6% และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 6.4% ตามลำดับ

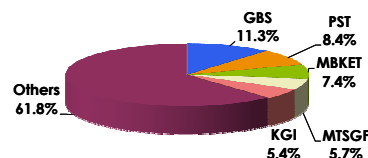
Investor Type	%					
	2011	2010	2009	2008	2007	2006
Local Institutions	33.6	32.7	28.4	26.4	25.3	27.9
Local Investor	60.0	57.2	60.3	56.6	55.0	52.9
Foreign Investor	6.4	10.1	11.3	17.1	19.7	19.2
Total	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0

No. of Client Account

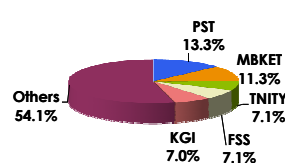
จำนวนการเปิดบัญชีซื้อขายปี 2554 ผู้ลงทุนในประเทศมีสัดส่วนของจำนวนการเปิดบัญชีซื้อขายสูงสุด คิดเป็น 95.9% ตามด้วยผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ คิดเป็น 2.5% และผู้ลงทุนต่างประเทศ คิดเป็น 1.6% ตามลำดับ ทั้งนี้จำนวนบัญชีซื้อขายเพิ่มขึ้นจากปีก่อน 21,003 บัญชี คิดเป็น 50.2%

	2011	2010	2009	2008	2007	2006
Local Institutions	1,561	1,186	1,008	724	424	242
Local Investor	60,300	39,975	28,066	14,817	8,873	4,065
Foreign Investor	1,022	719	472	353	234	119
Total	62,883	41,880	29,546	15,894	9,531	4,426

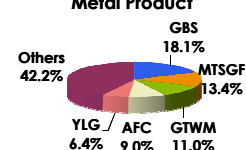
Broker Rank 2011
All Product



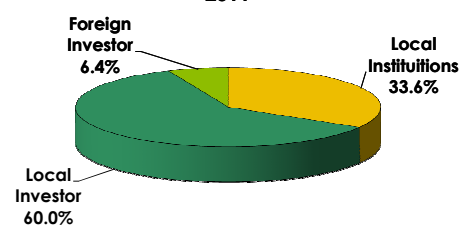
Broker Rank 2011
Index Product



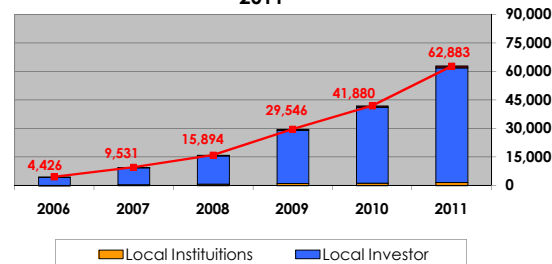
Broker Rank 2011
Metal Product



Investor Type
2011



Account Opening
2011



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.

สรุปภาวะการซื้อขายของตลาดอนุพันธ์ ปี 2554



ปริมาณและมูลค่าการซื้อขาย Futures & SET50 Index Options

	2011		2010		2009		2008		2007		2006
	Total	% YoY	Total	% YoY	Total	% YoY	Total	% YoY	Total	% YoY	Total
ปริมาณการซื้อขาย : สัญญา											
ปริมาณการซื้อขายรวม											
FUTURES	9,919,123	125%	4,412,119	48%	2,979,814	42%	2,102,936	71%	1,228,238	518%	198,737
- Brent Crude Oil	3,320	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- Metal Futures	4,020,845	314%	971,423	212%	311,591	-	-	-	-	-	-
- 50 Baht Gold	1,817,483	129%	792,960	154%	311,591	-	-	-	-	-	-
- 10 Baht Gold	2,171,795	1117%	178,463	-	-	-	-	-	-	-	-
- Silver	31,567	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- Interest Rate Futures	429	946%	41	-	-	-	-	-	-	-	-
- Single Stock Futures	1,578,092	63%	969,353	565%	145,758	3698%	3,838	-	-	-	-
- SET50 Index Futures	4,316,437	75%	2,471,302	-2%	2,522,465	20%	2,099,098	71%	1,228,238	518%	198,737
SET50 Index Options	107,993	1%	107,317	12%	95,504	109%	45,684	428%	8,646	-	-
รวม	10,027,116	122%	4,519,436	47%	3,075,318	43%	2,148,620	74%	1,236,884	522%	198,737
ปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวัน											
FUTURES	40,702	123%	18,233	47%	12,378	43%	8,652	73%	5,013	316%	1,204
- Brent Crude Oil	64	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- Metal Futures	16,479	311%	4,014	187%	1,397	-	-	-	-	-	-
- 50 Baht Gold	7,449	127%	3,277	135%	1,397.27	-	-	-	-	-	-
- 10 Baht Gold	8,901	419%	1,715.99	-	-	-	-	-	-	-	-
- Silver	236	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- Interest Rate Futures	2	120%	1	-	-	-	-	-	-	-	-
- Single Stock Futures	6,468	61%	4,006	568%	600	291%	154	-	-	-	-
- SET50 Index Futures	17,690	73%	10,212	-2%	10,381	22%	8,498	70%	5,013	316%	1,204
SET50 Index Options	443	0%	443	13%	393	112%	185	-10%	206	-	-
รวม	41,145	120%	18,676	46%	12,771	45%	8,837	69%	5,219	333%	1,204
Open Interest : สัญญา											
FUTURES	55,497	-28.1%	77,158	176%	27,979	26%	22,274	64%	13,609	79%	7,601
- Brent Crude Oil	9	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- Metal Futures	23,551	44.9%	16,249	186%	5,681	-	-	-	-	-	-
- 50 Baht Gold	8,627	-16.6%	10,344	82%	5,681	-	-	-	-	-	-
- 10 Baht Gold	14,695	148.9%	5,905	-	-	-	-	-	-	-	-
- Silver	229	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- Interest Rate Futures	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- Single Stock Futures	9,514	-73.1%	35,356	960%	3,337	1775%	178	-	-	-	-
- SET50 Index Futures	22,421	-12.3%	25,553	35%	18,961	-14%	22,096	62%	13,609	79%	7,601
SET50 Index Options	955	19.8%	797	164%	302	-36%	473	161%	181	-	-
รวม	56,452	-27.6%	77,955	176%	28,281	24%	22,747	65%	13,790	81%	7,601
จำนวนผู้ลงทุน : บัญชี***											
ผู้ลงทุนทั่วไป	60,300	51%	39,975	42%	28,066	89%	14,817	67%	8,873	118%	4,065
ผู้ลงทุนสถาบัน	1,561	32%	1,186	18%	1,008	39%	724	71%	424	75%	242
ผู้ลงทุนต่างประเทศ	1,022	42%	719	52%	472	34%	353	51%	234	97%	119
รวม (จำนวนบัญชี)	62,883	50%	41,880	42%	29,546	86%	15,894	67%	9,531	115%	4,426
สัดส่วนการซื้อขายผ่าน Internet	29.30%		24.90%		21.19%		14.82%		11.31%		6.76%
ปริมาณการซื้อขายของสมาชิก (Broker Rank) 5 อันดับแรก											
1 GBS (11.28%)	GBS (13.40%)	KEST (10.75%)	KEST (12.92%)	KGI (13.55%)	KGI (16.53%)						
2 PST (8.44%)	PST (9.25%)	PST (9.80%)	TNITY (12.48%)	TIPOL (13.41%)	BLS (9.75%)						
3 MBKET (7.40%)	KEST (7.91%)	KGI (7.78%)	PST (9.95%)	KEST (10.97%)	TIPOL (9.24%)						
4 MTSGF (5.67%)	TNITY (6.10%)	TNITY (7.46%)	KGI (8.95%)	PST (9.18%)	KEST (8.85%)						
5 KGI (5.42%)	KGI (5.64%)	GBS (7.26%)	ZMICO (4.97%)	BLS (7.09%)	CS (8.37%)						

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.