

KS-Derivatives

Actions:

- ทาง technical ที่ Long ใน Contract S50H10 ถือจนแกว่ง เพื่อเล็งผาด่าน 528-529 ไปแบ่งทำกำไรส่วนหนึ่ง 540 ในรูป และกลับเข้าไป Long เพิ่มถ้าทะลุ 540 กลับขึ้นมาระหว่างวัน กรณีนั้น Upside อาจสูงขึ้นไป 612 ตาม channel ในรูป
- จากรูปที่ 2 เงามอง Upside Gain ระยะสั้นของ SET50 ที่ 537

Figure 2: SET50 Top 10 Movers

Top 10 (Bt)	Current price (A)	%Mkt Cap	Direction	S-T Target (B)	Up/Downside (B-A)	Impact on SET50
PTT	247.0	15.2%	Up	254.0	7.0	2.0
PTTEP	148.5	10.7%	Up	151.5	3.0	1.0
ADVANC	84.3	5.4%	Up	89.5	5.3	1.6
BBL	117.5	4.9%	Up	118.5	1.0	0.2
SCC	228.0	5.9%	Up	242.0	14.0	1.7
SCB	85.5	6.3%	Up	88.3	2.8	0.9
BAY	21.5	2.8%	Up	22.6	1.1	0.7
DTAC	35.0	1.8%	Up	36.5	1.5	0.4
PTTCH	84.8	2.8%	Up	84.8	0.0	0.0
TOP	44.8	2.0%	Up	46.3	1.5	0.3
(Sum)		57.7%				8.7
Last	527.9		Up	536.6		

TECHNICAL VIEW ON STOCK FUTURES

Figure 4: PTTH10 Futures



- จากรูปที่ 4 ทาง Technical ถือหลัง Long PTH10 เพิ่มไปแล้ว เพื่อเล็งขึ้นไปแบ่งทำกำไรที่ 250-252 อีกส่วนเสี่ยงสั้นทะลุ ส่วน Stop-loss ขอ Update จนมีด

Figure 1: Technical Analysis



Figure 3: SET50 Futures Premium

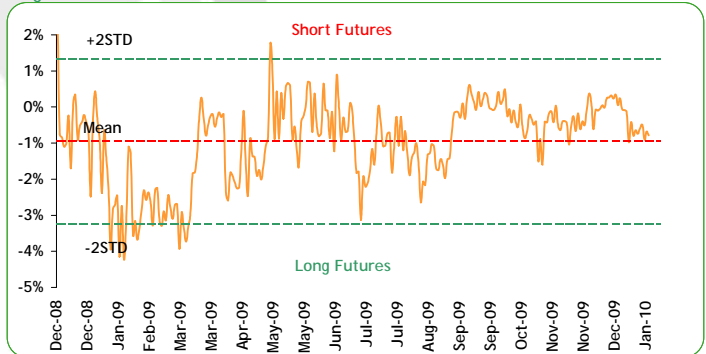


Figure 5: PTTEPH10 Futures



- จากรูปที่ 5 ส่วน PTTEPH10 ที่ Long เพิ่มไปแล้ว ถือเล็งขึ้นหลังจากทะลุด่านในรูปขึ้นมา เพื่อลุ้นอีกส่วนขึ้นต่อไป 153-154 หรือสูงกว่านั้น

The information, statements, forecasts and projections contained herein, including any expression of opinion, are based upon sources believed to be reliable, but their accuracy, completeness or correctness are not guaranteed. Expressions of opinion herein were arrived at after due and careful consideration and they were based upon the best information known to us then, and in our opinion are fair and reasonable in the circumstances prevailing at the time. Expressions of opinion contained herein are subject to change without notice.

SET50 CHANGE & OPEN INTERESTS
Figure 6: SET50 Change & Open Interests

	Index	Change %	Net Long / Short Contracts		
			Institutions	Foreign	Retail
LAST	302.6		-159	-104	263
			Cumulative Net Long / Short Contracts		
-2D	295.4	2.5%	-796	306	490
-1W	323.0	-6.3%	-666	278	388
-1M	316.0	-4.2%	-3,426	-962	4,388
YTD	316.5	-4.4%	-7,977	-1,744	9,721
Estimated Outstanding			-28,778	30,118	-1,349

STATISTICS
Figure 7: SET50 Futures & Options Prices

Series	Exp Date	Last Price	1 Day Chg	1 Day %Chg	Open Int.	Volume	Fair Value	Fair/Spot(%)	
S50H10	31-Mar-10	524.1	-2.3	-0.4%	19,868	3,920	525.9	-0.3%	
S50M10	30-Jun-10	521.2	-2.0	-0.4%	1,817	244	525.7	-0.9%	
S50U10	30-Sep-10	519.9	-3.1	-0.6%	164	5	527.1	-1.4%	
S50Z10	31-Dec-10	519.2	-2.3	-0.4%	41	2	529.0	-1.9%	
Call Option	Strike Price	Premium	Volume	Open Int.	Put Option	Strike Price	Premium	Volume	Open Int.
H10	490	43.4	0	1	H10	490	10.0	48	150
H10	500	36.4	0	30	H10	500	12.1	24	102
H10	510	30.1	4	220	H10	510	17.0	1	23
H10	520	24.1	4	457	H10	520	20.5	11	63
H10	530	21.5	20	605	H10	530	25.8	38	218
H10	540	17.0	7	158	H10	540	29.8	0	13

Figure 8: Stock Futures Snapshot

Products	Stock Price	Settlement Price	Stock/ Settlement(%)	Trade Volume		Chg in Price	Open Int.	Chg in OI	Fair Value	Fair/Spot(%)
				Value (Btmn)	Contracts					
PTT	247.0									
PTTH10		247.0	0.0%	0.000	1	-	37	1	249.4	-1.0%
PTTEP	148.5									
PTTEPH10		147.4	0.7%	0.008	52	-0.7	393	18	152.2	-3.1%
ADVANC	84.3									
ADVANCH10		84.8	-0.6%	0.001	11	-0.2	96	0	85.1	-0.3%
BANPU	628.0									
BANPUH10		629.0	-0.2%	-7.000	2	-7.0	31	1	-	-
BBL	117.5									
BBLH10		114.9	2.3%	-	1	-	2	-	-	-
ITD	3.0									
ITDH10		3.1	-2.6%	0.100	130	0.1	2782	150	-	-
KBANK	86.5									
KBANKH10		89.0	-2.8%	7.664	52	-0.7	393	18	-	-
KTB	10.3									
KTBH10		10.5	-1.9%	0.872	83	-	886	26	-	-
LH	6.0									
LHH10		6.1	-1.6%	0.777	129	-0.1	631	122	-	-
QH	2.6									
QHH10		2.6	-0.8%	-0.100	64	-0.1	757	-39	-	-
SCB	85.5									
SCBH10		84.3	1.4%	-	-	-	1	-	-	-
SCC	228.0									
SCCH10		229.0	-0.4%	-3.000	1	-3.0	6	-	-	-
TTA	29.3									
TTAH10		29.3	-0.2%	8.453	287	-0.1	1277	262	-	-

Kavee Chukitkasem (kavee.c@kasikornsecurities.com; Tel +662 696-0030)