

KS-Derivatives

Actions:

- ทาง technical ที่ Long ใน Contract S50H10 ถือจนแกว่ง เพื่อเล็งผาด่าน 528-529 ไปแบ่งทำกำไรส่วนหนึ่งที่ 540 ในรูป และกลับเข้าไป Long เพิ่มถ้าทะลุ 540 กลับขึ้นมาระหว่างวัน กรณีนั้น Upside อาจสูงขึ้นไปก็ 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	149.0	10.7%	Up	151.5	2.5	0.8
ADVANC	83.8	5.4%	Up	89.5	5.8	1.7
BBL	116.5	4.8%	Up	118.5	2.0	0.4
SCC	227.0	5.9%	Up	242.0	15.0	1.8
SCB	85.3	6.3%	Up	88.3	3.0	1.0
BAY	21.3	2.8%	Up	22.6	1.3	0.8
DTAC	34.8	1.8%	Up	36.5	1.8	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)		57.6%				9.3
Last	528.0		Up	537.3		

TECHNICAL VIEW ON STOCK FUTURES

Figure 4: PTTH10 Futures



- จากรูปที่ 4 ทาง Technical, ถือหลัง Long PTT เพิ่มไปแล้ว เพื่อเล็งขึ้นไปแบ่งทำกำไรที่ 250-252 อีกส่วนเสี่ยงสั้นทะลุ ส่วน Stoploss ขอ Update จนมีปิด

Figure 5: PTTEPH10 Futures

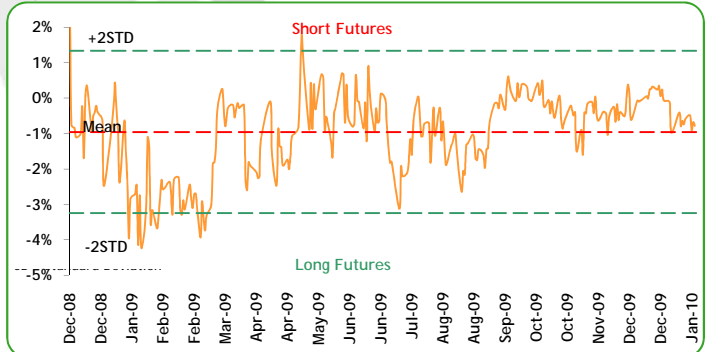


- จากรูปที่ 5 PTTEP ที่ Long, เพิ่มไปแล้ว ถือเล็งจึกแรกขึ้นต่อหลังจากทะลุด่านในรูปขึ้นมา เพื่อลุ้นจึกแรกขึ้นต่อไป 153-154 หรือสูงกว่านั้น

Figure 1: Technical Analysis



Figure 3: SET50 Futures Premium



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		583	-228	-355
			Cumulative Net Long / Short Contracts		
-2D	302.6	0.0%	424	-332	-92
-1W	323.0	-6.3%	-591	296	295
-1M	315.7	-4.1%	-2,126	-581	2,707
YTD	316.5	-4.4%	-7,394	-1,972	9,366
Estimated Outstanding			-28,354	29,786	-1,441

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	524.4	0.3	0.1%	19,503	3,946	526.2	-0.3%	
S50M10	30-Jun-10	521.3	0.1	0.0%	1,840	177	525.8	-0.9%	
S50U10	30-Sep-10	520.9	1.0	0.2%	166	4	528.1	-1.4%	
S50Z10	31-Dec-10	519.5	0.3	0.1%	41	#N/A N/A	529.3	-1.9%	
Call Option	Strike Price	Premium	Volume	Open Int.	Put Option	Strike Price	Premium	Volume	Open Int.
H10	490	43.0	0	1	H10	490	7.1	0	173
H10	500	35.9	0	30	H10	500	12.2	4	117
H10	510	29.5	0	223	H10	510	16.9	5	23
H10	520	25.0	53	459	H10	520	20.4	25	74
H10	530	19.0	0	622	H10	530	24.7	2	249
H10	540	14.9	0	163	H10	540	28.9	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		244.9	0.9%	0.002	7	-2.1	44	7	249.4	-1.8%
PTTEP	149.0									
PTTEPH10		148.2	0.5%	0.008	52	0.8	382	-11	152.7	-2.9%
ADVANC	83.8									
ADVANCH10		84.3	-0.7%	0.000	2	-0.5	94	-2	84.6	-0.3%
BANPU	622.0									
BANPUH10		629.0	-1.1%	-	-	-	31	0	-	-
BBL	116.5									
BBLH10		117.0	-0.4%	2.100	2	2.1	3	-	-	-
ITD	3.1									
ITDH10		3.2	-3.8%	0.100	151	0.1	2883	101	-	-
KBANK	86.0									
KBANKH10		89.0	-3.4%	7.677	52	0.8	382	-11	-	-
KTB	10.5									
KTBH10		10.5	0.0%	1.269	121	-	893	7	-	-
LH	6.0									
LHH10		6.0	0.0%	0.432	72	-0.1	661	30	-	-
QH	2.6									
QHH10		2.6	0.0%	-	6	-	762	5	-	-
SCB	85.3									
SCBH10		84.3	1.1%	-	-	-	1	-	-	-
SCC	227.0									
SCCH10		229.0	-0.9%	-	-	-	6	-	-	-
TTA	29.8									
TTAH10		29.5	0.8%	3.028	103	0.2	1286	9	-	-

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