



Macro Theme and SET Direction



สรุปตลาด SET50 Index Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
S50U13	954.0	970.5	942.2	953.0	969.9	16.5	25,168	42,302
S50V13	957.2	957.2	951.0	952.5	951.0	17.5	2	12
S50X13	-	-	-	952.2	-	16.6	0	0
S50Z13	956.0	972.9	944.5	955.1	972.4	16.6	2,877	9,807
S50H14	954.0	968.5	941.0	951.6	967.8	16.0	161	291
S50M14	950.0	965.4	937.9	947.0	965.0	17.4	97	233

สรุปตลาด Currency Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
USDU13	32.3	32.3	31.9	32.3	32.0	-0.32	2,749	7,474
USDV13	32.2	32.2	32.1	32.2	32.1	-0.1	25	752
USDX13	32.3	32.4	32.2	32.3	32.2	-0.19	521	591
USDZ13	32.3	32.4	32.2	32.3	32.2	-0.14	658	2,862

สรุปยอดซื้อขายสุทธิ Futures ตามประเภทหลักทรัพย์ (สัญญา)

	Foreign			Institution			Local		
	Long	Short	Net	Long	Short	Net	Long	Short	Net
SET50 Index Futures	5,613	5,647	-34	9,329	10,649	-1,320	13,363	12,009	1,354
Energy Futures	96	29	67	0	0	0	140	207	-67
Metal Futures	151	1,012	-861	3,428	3,215	213	3,100	2,452	648
Single Stock Futures	212	16	196	5,162	8,737	-3,575	16,469	13,090	3,379
Currency Futures	23	23	0	1,600	1,623	-23	2,330	2,307	23

สรุปตลาด Futures Gold & Silver & Oil Futures

	Price			Settlement Price		Volume	Open Interest
	High	Low	Close	Prior	Change		
Future Bt50							
GFV13	21,000	20,810	20,830	21,060	-240	953	3,749
GFZ13	21,060	20,910	20,920	21,160	-240	322	2,432
GFG14	21,130	21,050	21,050	21,270	-220	28	56
Future Bt10							
GF10V13	20,990	20,800	20,810	21,060	-240	3,880	5,843
GF10Z13	21,110	20,910	20,910	21,160	-240	940	3,666
GF10G14	21,220	20,990	21,010	21,270	-270	556	564
SVV13	-	-	-	767	-	0	3
SVZ13	-	-	-	775	-	0	10
SVG14	-	-	-	801	-	0	1
Brent Crude Oil Futures							
BRU13	3,605	3,555	3,574	3,627	-53	89	189
BRV13	3,575	3,514	3,559	3,607	-51	77	222
BRX13	3,550	3,486	3,515	3,600	-85	70	79



SET50

	Expiration date	Days to maturity	Rf	FV of periodic dividend	Current spot	Fair future price	Current future price	Premium / Discount from fair price (pts)	premium / discount (%)	Premium / Discount from spot price (pts)
S50U13	27-Sep-13	15	2.54%	10.4	970.21	960.9	969.5	8.6	0.9	-0.7
S50Z13	27-Dec-13	106	2.55%	0.8	970.21	976.6	971.7	-4.9	-0.5	1.5
S50H14	28-Mar-14	197	2.56%	7.8	970.21	975.9	967.6	-8.3	-0.9	-2.6
S50M14	27-Jun-14	288	2.57%	10.5	970.21	979.6	964.4	-15.2	-1.5	-5.8

Gold

	Expiration date	Days to maturity	Current spot (USD)	Rf	Current FX	Fair future price	Current future price	Premium / Discount from fair price (Bt)	premium / discount (%)
GFV13	30-Oct-13	48	1,364.9	2.54%	31.92	20,778	20,740	-38	-0.2%
GFZ13	27-Dec-13	106	1,364.9	2.54%	31.92	20,862	20,870	8	0.0%
GFG14	27-Feb-14	168	1,364.9	2.55%	31.92	20,954	20,990	36	0.2%

Silver

	Expiration date	Days to maturity	Current spot (USD)	Rf	Current FX	Fair future price	Current future price	Premium / Discount from fair price (Bt)	premium / discount (%)
SVV13	30-Oct-13	48	23.125	2.54%	31.92	741	740	-1	-0.1%
SVZ13	27-Dec-13	106	23.125	2.54%	31.92	744	#N/A	#N/A	#N/A
SVG14	27-Feb-14	168	23.125	2.55%	31.92	747	869	122	16.4%

Brent

	Expiration date	Days to maturity	Current spot (USD)	Rf	Current FX	Fair future price	Current future price	Premium / Discount from fair price (Bt)	premium / discount (%)
BRU13	13-Sep-13	1	110.19	2.54%	31.92	3,518	3,578	60	1.7%
BRV13	16-Oct-13	34	110.19	2.54%	31.92	3,526	3,553	27	0.8%
BRX13	14-Nov-13	63	110.19	2.54%	31.92	3,533	3,535	2	0.1%

USD

	Expiration date	Days to maturity	Current FX	TH1Y	US1Y	Fair future price	Current future price	Premium / Discount from fair price (Bt)	premium / discount (%)
USDU13	27-Sep-13	15	31.92	2.57%	0.14%	31.95	31.95	0.00	0.0%
USDV13	30-Oct-13	48	31.92	2.57%	0.14%	32.02	32.10	0.08	0.2%
USDX13	28-Nov-13	77	31.92	2.57%	0.14%	32.08	32.11	0.03	0.1%

* In computing fair future price of oil, gold, and silver we disregard storage cost & convenience yield for simplicity reason

Fair gold spot price

	Gold spot (USD/oz)											
	1,314	1,324	1,334	1,344	1,354	1,364	1,374	1,384	1,394	1,404	1,414	
31.67	19,777	19,175	18,724	18,423	18,272	18,272	18,423	18,724	19,175	19,777	20,530	
31.72	19,653	19,054	18,605	18,306	18,157	18,157	18,306	18,605	19,054	19,653	20,401	
31.77	19,559	18,963	18,517	18,219	18,070	18,070	18,219	18,517	18,963	19,559	20,303	
31.82	19,496	18,903	18,458	18,161	18,012	18,012	18,161	18,458	18,903	19,496	20,238	
31.87	19,465	18,873	18,428	18,132	17,984	17,984	18,132	18,428	18,873	19,465	20,206	
THB/USD	31.92	19,465	18,873	18,428	18,132	17,984	17,984	18,132	18,428	18,873	19,465	20,206
	31.97	19,496	18,903	18,458	18,161	18,012	18,012	18,161	18,458	18,903	19,496	20,238
	32.02	19,559	18,963	18,517	18,219	18,070	18,070	18,219	18,517	18,963	19,559	20,303
	32.07	19,653	19,054	18,605	18,306	18,157	18,157	18,306	18,605	19,054	19,653	20,401
	32.12	19,777	19,175	18,724	18,423	18,272	18,272	18,423	18,724	19,175	19,777	20,530
	32.17	19,934	19,327	18,872	18,568	18,416	18,416	18,568	18,872	19,327	19,934	20,692

Fair Silver spot price

	Silver spot (USD/oz)											
	20.6	21.1	21.6	22.1	22.6	23.1	23.6	24.1	24.6	25.1	25.6	
31.67	653	590	542	511	495	495	511	542	590	653	732	
31.72	654	591	543	511	496	496	511	543	591	654	734	
31.77	655	592	544	512	496	496	512	544	592	655	735	
31.82	656	593	545	513	497	497	513	545	593	656	736	
31.87	657	594	546	514	498	498	514	546	594	657	737	
THB/USD	31.92	658	595	547	515	499	499	515	547	595	658	738
	31.97	659	595	547	516	500	500	516	547	595	659	739
	32.02	660	596	548	516	500	500	516	548	596	660	740
	32.07	661	597	549	517	501	501	517	549	597	661	742
	32.12	662	598	550	518	502	502	518	550	598	662	743
	32.17	664	599	551	519	503	503	519	551	599	664	744

บริษัทหลักทรัพย์ ทรินิตี้ จำกัด, 179 อาคารบางกอก ซิตี้ ทาวเวอร์ ชั้น 25-26, 29 ถนนสาทรใต้ เขตสาทร กรุงเทพฯ 10120 โทรศัพท์ 0-2801-9100 โทรสาร 0-2801-9399

รายงานฉบับนี้จัดทำขึ้นโดยข้อมูลเท่าที่ปรากฏและเชื่อว่าเป็นที่น่าเชื่อถือได้แต่ไม่ถือเป็นการยืนยันความถูกต้องและความสมบูรณ์ของข้อมูลนั้นๆ โดยบริษัทหลักทรัพย์ ทรินิตี้ จำกัด ผู้จัดทำขอสงวนสิทธิ์ในการเปลี่ยนแปลงความเห็นหรือประมาณการต่างๆ ที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้โดยไม่ต้องแจ้งล่วงหน้า รายงานฉบับนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ประกอบการตัดสินใจของนักลงทุน โดยไม่ได้เป็นการชี้แนะหรือชักชวนให้นักลงทุนทำการซื้อหรือขาย หลักทรัพย์ หรือตราสารทางการเงินใดๆ ที่ปรากฏในรายงาน



Fair Brent spot price

		Brent spot (USD/bbl)										
		100	102	104	106	108	110	112	114	116	118	120
	31.67	3,173	2,920	2,730	2,603	2,540	2,540	2,603	2,730	2,920	3,173	3,490
	31.72	3,178	2,924	2,734	2,607	2,544	2,544	2,607	2,734	2,924	3,178	3,495
	31.77	3,183	2,929	2,738	2,611	2,548	2,548	2,611	2,738	2,929	3,183	3,501
	31.82	3,188	2,933	2,743	2,615	2,552	2,552	2,615	2,743	2,933	3,188	3,506
	31.87	3,193	2,938	2,747	2,619	2,556	2,556	2,619	2,747	2,938	3,193	3,512
THB/USD	31.92	3,198	2,943	2,751	2,624	2,560	2,560	2,624	2,751	2,943	3,198	3,517
	31.97	3,203	2,947	2,755	2,628	2,564	2,564	2,628	2,755	2,947	3,203	3,523
	32.02	3,208	2,952	2,760	2,632	2,568	2,568	2,632	2,760	2,952	3,208	3,528
	32.07	3,213	2,957	2,764	2,636	2,572	2,572	2,636	2,764	2,957	3,213	3,534
	32.12	3,218	2,961	2,768	2,640	2,576	2,576	2,640	2,768	2,961	3,218	3,539
	32.17	3,223	2,966	2,773	2,644	2,580	2,580	2,644	2,773	2,966	3,223	3,545

วันที่	เหตุการณ์
11 กันยายน	เยอรมนี - CPI Aug consensus 0.0% / Prior 0.0%
11 กันยายน	อังกฤษ - Claimant Count Aug / Jul 4.3%
11 กันยายน	อังกฤษ - ILO Unemployment Aug / Jul 7.8%
11 กันยายน	สหรัฐฯ - Wholesale Inventories Jul consensus 0.3% / Jun -0.2%
11 กันยายน	ญี่ปุ่น - Machine Orders Jul consensus 2.0% / Jun -2.7%
12 กันยายน	ฝรั่งเศส - CPI Aug consensus 0.6% / Jul -0.3%
12 กันยายน	ยุโรป - Industrial Production Jul consensus 0.0% / Jun 0.7%
12 กันยายน	สหรัฐฯ - Jobless Claims wk9/7 consensus 330 K / Prior 323 K
12 กันยายน	สหรัฐฯ - Export Prices Aug consensus 0.1% / Jul -0.1%
12 กันยายน	สหรัฐฯ - Import Prices Aug consensus 0.5% / Jul 0.2%
12 กันยายน	สหรัฐฯ - Treasury Budget Aug / Jul \$-97.6 B
13 กันยายน	ยุโรป - Merchandise Trade Jul / Jun E14.9 B
13 กันยายน	สหรัฐฯ - PPI Aug consensus 0.2% / Jul 0.0%
13 กันยายน	สหรัฐฯ - Retail Sales Aug consensus 0.5% / Jul 0.2%
13 กันยายน	สหรัฐฯ - Consumer Sentiment Sep consensus 82.0 / Aug 82.1
13 กันยายน	สหรัฐฯ - Business Inventories Jul consensus 0.3% / Jun 0.0%
16 กันยายน	ยุโรป - HICP Aug / Jul -0.5%
16 กันยายน	สหรัฐฯ - Empire State Mfg Survey Sep / Aug 8.24
16 กันยายน	สหรัฐฯ - Industrial Production Aug / Jul 0.0%