

ตารางผนวก ค1

กระแสเงินสดหรือผลตอบแทนรวมที่คาดหวังจากการลงทุนของ Minimum M-Absolute Portfolio

อัตราผลตอบแทน(Yield) 3.10%

วันที่	ราคาตลาด (บาทต่อหน่วย)		จำนวนหน่วย		มูลค่าของกลุ่มหลักทรัพย์ (บาท)									
	LB033A	LB046A	LB033A	LB046A	ผลตอบแทนรวม	ผลตอบแทน จากราคารวม	ดอกเบี๋ยรับ รวม	ผลตอบแทน ลงทุนต่อรวม	LB033A			LB046A		
									ผลตอบแทน จากราคา	ดอกเบี๋ยรับ	ผลตอบแทน ลงทุนต่อ	ผลตอบแทน จากราคา	ดอกเบี๋ยรับ	ผลตอบแทน ลงทุนต่อ
03/01/2544	1,063.17	1,095.12	847	91	1,000,000.00	1,000,000.00	-	-	900,000.00			100,000.00		
05/03/2544	1,041.25	1,111.23	868	91	1,005,150.34	982,916.59	22,233.75	-	881,445.48	22,233.75	-	101,471.11		-
15/06/2544	1,050.24	1,089.53	868	94	1,013,814.42	988,544.96	25,077.50	191.96	889,055.54	22,233.75	191.96	99,489.42	2,843.75	-
05/09/2544	1,031.41	1,097.09	890	94	1,020,961.52	973,289.55	47,311.25	360.72	873,110.18	44,467.50	341.00	100,179.37	2,843.75	19.72
17/12/2544	1,040.40	1,075.44	890	97	1,029,869.02	978,925.38	50,155.00	788.64	880,722.48	44,467.50	731.67	98,202.90	5,687.50	56.98
05/03/2545	1,020.88	1,082.54	913	97	1,036,547.48	963,051.36	72,388.75	1,107.38	864,200.77	66,701.25	1,012.51	98,850.59	5,687.50	94.86
17/06/2545	1,029.87	1,060.77	913	100	1,045,678.83	968,671.61	75,232.50	1,774.72	871,808.89	66,701.25	1,608.64	96,862.72	8,531.25	166.08
05/09/2545	1,010.71	1,067.94	937	100	1,052,873.54	953,111.76	97,466.25	2,295.54	855,593.75	88,935.00	2,070.62	97,518.01	8,531.25	224.92
16/12/2545	1,019.44	1,045.95	937	103	1,061,982.99	958,490.78	100,310.00	3,182.21	862,980.61	88,935.00	2,856.32	95,510.17	11,375.00	325.89
28/02/2546	1,025.82	1,052.50	937	103	1,068,577.55	964,437.87	100,310.00	3,829.68	868,330.17	88,935.00	3,430.59	96,107.70	11,375.00	399.09

ตารางผนวก ค2

การแสดงผลการดำเนินงานของ Minimum M-Absolute Portfolio

วันที่	อัตราผลตอบแทน(Yield) (%)		ราคาตลาด (บาทต่อหน่วย)		จำนวนหน่วย		มูลค่าของกลุ่มหลักทรัพย์ (บาท)			ดอกเบี้ยรับรวม	ผลตอบแทน การลงทุนต่อ รวม	มูลค่าเงินลงทุนและ ผลตอบแทนรวม ทั้งหมด	อัตรา ผลตอบแทนที่ ได้รับจริง(Ri)	อัตราดอกเบี้ยเงิน ฝากประจำ 12 เดือนเฉลี่ย(Rf)	อัตราเฉลี่ย (Ri - Rf)	ค่าส่วน เบี่ยงเบน มาตรฐาน
	LB033A	LB046A	LB033A	LB046A	LB033A	LB046A	LB033A	LB046A	รวม							
03/01/2544	3.048650	3.401320	1,063.17	1,095.12	847	91	900,000.00	100,000.00	1,000,000.00	0.00	0.00	1,000,000.00				
05/03/2544	2.230000	2.500000	1,058.66	1,131.11	847	91	896,178.65	103,285.79	999,464.43	22,233.75	0.00	1,021,698.18				
30/03/2544	2.520000	2.850000	1,054.62	1,121.63	847	91	892,762.80	102,420.76	995,183.56	22,233.75	53.30	1,017,470.61	7.536850	3.20	4.336850	19.131140
15/06/2544	3.594000	4.184000	1,041.85	1,057.62	847	91	881,953.40	96,575.72	978,529.13	25,077.50	217.46	1,003,824.09				
29/06/2544	3.940000	4.426000	1,037.58	1,052.42	891	47	924,751.70	49,686.61	974,438.31	25,077.50	251.13	999,766.94	-6.798304	3.00	-9.798304	99.226265
05/09/2544	3.473333	4.351667	1,025.90	1,063.02	891	47	914,337.11	50,187.04	964,524.15	48,466.25	414.65	1,013,405.05				
28/09/2544	3.201667	3.851667	1,031.96	1,079.06	891	47	919,746.23	50,944.25	970,690.48	48,466.25	521.54	1,019,678.27	8.231006	3.00	5.231006	25.685353
17/12/2544	2.650000	2.874000	1,045.84	1,081.09	891	47	932,114.36	51,040.11	983,154.48	49,935.00	893.34	1,033,982.81				
28/12/2544	2.551429	2.737143	1,047.84	1,085.42	921	18	965,306.86	19,832.83	985,139.69	49,935.00	945.79	1,036,020.48	6.585122	2.95	3.634023	11.711370
05/03/2545	2.224000	2.604000	1,029.67	1,093.92	921	18	948,567.02	19,988.16	968,555.17	74,111.25	1,265.25	1,043,931.68				
29/03/2545	2.144286	2.704286	1,031.92	1,093.54	921	18	950,641.22	19,981.14	970,622.36	74,111.25	1,421.60	1,046,155.22	3.981866	2.71	1.267031	0.670649
17/06/2545	2.071667	2.317500	1,037.28	1,076.53	921	18	955,580.75	19,670.33	975,251.08	74,673.75	1,942.23	1,051,867.06				
28/06/2545	2.085714	2.330000	1,037.83	1,077.02	940	0	975,763.98	-	975,763.98	74,673.75	2,014.06	1,052,451.79	2.436087	2.60	-0.163913	0.528307
05/09/2545	1.870000	2.028333	1,016.82	1,087.22	940	0	956,012.23	-	956,012.23	99,348.75	2,464.64	1,057,825.62				
30/09/2545	1.934286	2.107143	1,017.84	1,087.35	940	0	956,971.31	-	956,971.31	99,348.75	2,672.27	1,058,992.33	2.434809	2.60	-0.165191	0.530166
16/12/2545	1.711667	1.860000	1,022.47	1,064.72	940	0	961,324.32	-	961,324.32	99,348.75	3,311.88	1,063,984.95				
27/12/2545	1.700833	1.830833	1,023.02	1,065.76	940	0	961,837.49	-	961,837.49	99,348.75	3,403.27	1,064,589.51	2.210539	2.17	0.042357	0.907056
28/02/2546	1.460000	1.528333	1,026.05	1,073.13	940	0	964,684.87	-	964,684.87	99,348.75	3,926.72	1,067,960.35	1.848432	2.00	-0.151568	1.727916
													3.162934	2.69	0.470255	4.473788

ตารางผนวก ค3

การคำนวณดอกเบี้ยรับและผลตอบแทนจากการลงทุนต่อในเงินฝากประจำ 12 เดือน

ของ Minimum M-Absolute Portfolio

วันที่	ดอกเบี้ยรับ(Coupon)		อัตราดอกเบี้ย เงินฝากประจำ 12 เดือน	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน จากการ ลงทุนต่อ	ดอกเบี้ยรับและ ผลตอบแทนจาก การลงทุนต่อ
	LB033A	LB046A				
05/03/2544	22,233.75		3.50	22,233.75	0.00	22,233.75
30/03/2544				22,233.75	53.30	22,287.05
15/06/2544		2,843.75	3.50	25,077.50	217.46	25,294.96
29/06/2544				25,077.50	251.13	25,328.63
05/09/2544	23,388.75		3.50	48,466.25	414.65	48,880.90
28/09/2544				48,466.25	521.54	48,987.79
17/12/2544		1,468.75	3.00	49,935.00	893.34	50,828.34
28/12/2544				49,935.00	945.79	50,880.79
05/03/2545	24,176.25		3.00	74,111.25	1,265.25	75,376.50
29/03/2545				74,111.25	1,421.60	75,532.85
17/06/2545		562.50	3.00	74,673.75	1,942.23	76,615.98
28/06/2545				74,673.75	2,014.06	76,687.81
05/09/2545	24,675.00		3.00	99,348.75	2,464.64	101,813.39
30/09/2545				99,348.75	2,672.27	102,021.02
16/12/2545		0.00	3.00	99,348.75	3,311.88	102,660.63
27/12/2545				99,348.75	3,403.27	102,752.02
28/02/2546				99,348.75	3,926.72	103,275.47

ตารางผนวก ค4

การจัดสรรน้ำหนักของแต่ละพันธบัตรใน Minimum M-Absolute Portfolio

วันที่	ระยะเวลา การลงทุน (ปี)	Duration ของ Portfolio	Minimum M-Absolute Portfolios		M-Absolute ของ Portfolios
			LB033A	LB046A	
3/01/2544	2.16	2.16	0.900000	0.100000	0.240000
29/06/2544	1.67	1.67	0.949010	0.050990	0.145114
28/12/2544	1.17	1.17	0.979868	0.020132	0.072718
28/06/2545	0.67	0.68	1.000000	0.000000	0.030679
27/12/2545	0.17	0.19	1.000000	0.000000	0.016301
28/02/2546	0.00	0.01	1.000000	0.000000	

ตารางผนวก ค5

กระแสเงินสดหรือผลตอบแทนรวมที่คาดหวังจากการลงทุนของ Minimum M-Square Portfolio

อัตราผลตอบแทน(Yield) 3.10%

วันที่	ราคาตลาด (บาทต่อหน่วย)		จำนวนหน่วย		มูลค่าของกลุ่มหลักทรัพย์ (บาท)									
	LB033A	LB03OA	LB033A	LB03OA	ผลตอบแทนรวม	ผลตอบแทน จากราคารวม	ดอกเบี้ยรับ รวม	ผลตอบแทน ลงทุนต่อรวม	LB033A			LB03OA		
									ผลตอบแทน จากราคา	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน ลงทุนต่อ	ผลตอบแทน จากราคา	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน ลงทุนต่อ
03/01/2544	1,063.17	1,151.08	715	209	1,000,000.00	1,000,000.00	-	-	760,000.00	-	-	240,000.00	-	-
05/03/2544	1,041.25	1,160.30	733	209	1,005,024.06	986,255.31	18,768.75	-	744,331.74	18,768.75	-	241,923.58	-	-
17/04/2544	1,045.03	1,123.21	733	216	1,008,681.52	981,223.37	27,390.00	68.14	747,034.14	18,768.75	68.14	234,189.24	8,621.25	-
05/09/2544	1,031.41	1,136.64	752	216	1,020,838.69	974,281.86	46,158.75	398.08	737,293.04	37,537.50	295.02	236,988.82	8,621.25	103.06
15/10/2544	1,034.89	1,099.27	752	224	1,024,287.98	968,980.22	54,780.00	527.76	739,782.80	37,537.50	422.77	229,197.42	17,242.50	104.99
05/03/2545	1,020.88	1,112.41	771	224	1,036,448.19	961,706.86	73,548.75	1,192.58	729,769.53	56,306.25	880.21	231,937.33	17,242.50	312.36
17/04/2545	1,024.59	1,075.14	771	233	1,040,187.06	956,586.22	82,170.00	1,430.84	732,419.06	56,306.25	1,087.84	224,167.15	25,863.75	343.00
05/09/2545	1,010.71	1,087.99	791	233	1,052,724.02	949,348.32	100,938.75	2,436.96	722,501.39	75,075.00	1,780.67	226,846.93	25,863.75	656.29
14/10/2545	1,014.04	1,050.37	791	242	1,056,205.39	943,882.48	109,560.00	2,762.91	724,880.09	75,075.00	2,033.70	219,002.39	34,485.00	729.21
28/02/2546	1,025.82	1,062.57	791	242	1,068,577.55	954,950.21	109,560.00	4,067.34	733,404.49	75,075.00	2,929.18	221,545.72	34,485.00	1,138.16

ตารางผนวก ค6

การแสดงผลการดำเนินงานของ Minimum M-Square Portfolio

วันที่	อัตราผลตอบแทน(Yield) (%)		ราคาตลาด (บาทต่อหน่วย)		จำนวนหน่วย		มูลค่าของกลุ่มหลักทรัพย์ (บาท)			ดอกเบี้ยรับรวม	ผลตอบแทน การลงทุนต่อ รวม	มูลค่าเงินลงทุน และผลตอบแทน รวมทั้งหมด	อัตรา ผลตอบแทนที่ ได้รับจริง(Ri)	อัตราดอกเบี้ยเงิน ฝากประจำ 12 เดือนเฉลี่ย(Rf)	อัตราเฉลี่ย (Ri - Rf)	ค่าส่วน เบี่ยงเบน มาตรฐาน
	LB033A	LB03OA	LB033A	LB03OA	LB033A	LB03OA	LB033A	LB03OA	รวม							
03/01/2544	3.048650	3.211206	1,063.17	1,151.08	715	209	760,000.00	240,000.00	1,000,000.00	0.00	0.00	1,000,000.00				
05/03/2544	2.230000	2.326667	1,058.66	1,181.30	715	209	756,773.08	246,301.85	1,003,074.93	18,768.75	0.00	1,021,843.68				
30/03/2544	2.520000	2.656667	1,054.62	1,174.40	715	209	753,888.59	244,863.39	998,751.98	18,768.75	44.99	1,017,565.72	7.579030	3.20	4.379030	19.510943
17/04/2544	2.541667	2.731667	1,055.52	1,132.69	715	209	754,527.44	236,166.14	990,693.58	27,390.00	77.39	1,018,160.97				
29/06/2544	3.940000	4.174000	1,037.58	1,105.22	828	102	859,353.78	112,792.27	972,146.05	27,390.00	269.12	999,805.17	-6.818951	3.00	-9.818951	99.617600
05/09/2544	3.473333	3.765000	1,025.90	1,122.40	828	102	849,675.70	114,545.36	964,221.06	49,125.00	447.72	1,013,793.78				
28/09/2544	3.201667	3.486667	1,031.96	1,130.79	828	102	854,702.29	115,401.61	970,103.91	49,125.00	556.06	1,019,784.97	8.259831	3.00	5.259831	25.988792
15/10/2544	3.034000	3.150000	1,035.80	1,098.25	828	102	857,875.98	112,080.53	969,956.51	53,332.50	636.14	1,023,925.15				
28/12/2544	2.551429	2.657143	1,047.84	1,114.31	895	39	938,326.98	43,243.07	981,570.05	53,332.50	1,014.58	1,035,917.13	6.497778	2.95	3.546679	11.128011
05/03/2545	2.224000	2.356000	1,029.67	1,124.73	895	39	922,055.01	43,647.46	965,702.47	76,826.25	1,357.23	1,043,885.95				
29/03/2545	2.144286	2.308571	1,031.92	1,127.22	895	39	924,071.24	43,744.15	967,815.39	76,826.25	1,521.43	1,046,163.08	4.026616	2.71	1.311781	0.747715
17/04/2545	2.126667	2.295000	1,033.22	1,087.48	895	39	925,238.69	42,202.16	967,440.85	78,435.00	1,651.43	1,047,527.28				
28/06/2545	2.085714	2.191429	1,037.83	1,093.78	936	0	971,808.86	-	971,808.86	78,435.00	2,146.85	1,052,390.71	2.409159	2.60	-0.190841	0.566635
05/09/2545	1.870000	1.952500	1,016.82	1,101.03	936	0	952,137.18	-	952,137.18	103,005.00	2,621.63	1,057,763.81				
30/09/2545	1.934286	1.987857	1,017.84	1,102.11	936	0	953,092.37	-	953,092.37	103,005.00	2,838.26	1,058,935.63	2.436596	2.60	-0.163404	0.526081
14/10/2545	1.937500	1.978333	1,018.58	1,061.83	936	0	953,784.53	-	953,784.53	103,005.00	2,959.98	1,059,749.51				
27/12/2545	1.700833	1.746667	1,023.02	1,067.98	936	0	957,938.82	-	957,938.82	103,005.00	3,597.83	1,064,541.65	2.214176	2.17	0.045994	0.898201
28/02/2546	1.460000	1.483333	1,026.05	1,072.88	936	0	960,774.66	-	960,774.66	103,005.00	4,140.86	1,067,920.53	1.852961	2.00	-0.147039	1.713349
													3.161911	2.69	0.469231	4.481871

ตารางผนวก ค7

การคำนวณดอกเบี้ยรับและผลตอบแทนจากการลงทุนต่อในเงินฝากประจำ 12 เดือน

ของ Minimum M-Square Portfolio

วันที่	ดอกเบี้ยรับ(Coupon)		อัตราดอกเบี้ย เงินฝากประจำ 12 เดือน	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน จากการ ลงทุนต่อ	ดอกเบี้ยรับและ ผลตอบแทนจาก การลงทุนต่อ
	LB033A	LB03OA				
05/03/2544	18,768.75		3.50	18,768.75	0.00	18,768.75
30/03/2544				18,768.75	44.99	18,813.74
17/04/2544		8,621.25	3.50	27,390.00	77.39	27,467.39
29/06/2544				27,390.00	269.12	27,659.12
05/09/2544	21,735.00		3.50	49,125.00	447.72	49,572.72
28/09/2544				49,125.00	556.06	49,681.06
15/10/2544		4,207.50	3.50	53,332.50	636.14	53,968.64
28/12/2544				53,332.50	1,014.58	54,347.08
05/03/2545	23,493.75		3.00	76,826.25	1,357.23	78,183.48
29/03/2545				76,826.25	1,521.43	78,347.68
17/04/2545		1,608.75	3.00	78,435.00	1,651.43	80,086.43
28/06/2545				78,435.00	2,146.85	80,581.85
05/09/2545	24,570.00		3.00	103,005.00	2,621.63	105,626.63
30/09/2545				103,005.00	2,838.26	105,843.26
14/10/2545		0.00	3.00	103,005.00	2,959.98	105,964.98
27/12/2545				103,005.00	3,597.83	106,602.83
28/02/2546				103,005.00	4,140.86	107,145.86

ตารางผนวก ค8

การจัดสรรน้ำหนักของแต่ละพันธบัตรใน Minimum M-Square Portfolio

วันที่	ระยะเวลา การลงทุน (ปี)	Duration ของ Portfolio	Minimum M-Square Portfolios		M-Square ของ Portfolios
			LB033A	LB03OA	
3/01/2544	2.16	2.16	0.760000	0.240000	0.270000
29/06/2544	1.67	1.67	0.883976	0.116024	0.125743
28/12/2544	1.17	1.17	0.955945	0.044055	0.045673
28/06/2545	0.67	0.68	1.000000	0.000000	0.006181
27/12/2545	0.17	0.19	1.000000	0.000000	0.000266
28/02/2546	0.00	0.01	1.000000	0.000000	

ตารางผนวก ค9

กระแสเงินสดหรือผลตอบแทนรวมที่คาดหวังจากการลงทุนของ Random Portfolio (1)

อัตราผลตอบแทน(Yield) 3.10%

วันที่	ราคาลาด (บาทต่อหน่วย)		จำนวนหน่วย		มูลค่าของกลุ่มหลักทรัพย์ (บาท)									
	LB033A	LB038A	LB033A	LB038A	ผลตอบแทนรวม	ผลตอบแทน จากราคารวม	ดอกเบี้ยรับ รวม	ผลตอบแทน ลงทุนต่อรวม	LB033A			LB038A		
									ผลตอบแทน จากราคา	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน ลงทุนต่อ	ผลตอบแทน จากราคา	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน ลงทุนต่อ
03/01/2544	1,062.21	1,208.28	593	306	1,000,000.00	1,000,000.00	-	-	630,000.00	-	-	370,000.00	-	-
28/02/2544	1,067.09	1,164.51	593	319	1,004,796.90	989,496.90	15,300.00	-	632,898.99	-	-	356,597.91	15,300.00	-
05/03/2544	1,041.25	1,165.10	608	319	1,005,224.28	974,350.29	30,866.25	7.74	617,572.01	15,566.25	-	356,778.28	15,300.00	7.74
31/08/2544	1,057.08	1,132.96	608	333	1,020,531.99	973,893.75	46,166.25	472.00	626,959.41	15,566.25	236.62	346,934.34	30,600.00	235.38
05/09/2544	1,031.41	1,133.43	624	333	1,021,039.99	958,812.57	61,732.50	494.93	611,732.00	31,132.50	246.55	347,080.56	30,600.00	248.38
28/02/2545	1,046.82	1,100.23	624	349	1,036,230.01	957,787.29	77,032.50	1,410.22	620,873.61	31,132.50	715.47	336,913.67	45,900.00	694.75
05/03/2545	1,020.88	1,100.70	640	349	1,036,598.67	942,545.43	92,598.75	1,454.49	605,489.75	46,698.75	740.10	337,055.68	45,900.00	714.39
02/09/2545	1,036.57	1,067.74	640	365	1,052,598.49	941,761.64	107,898.75	2,938.11	614,797.12	46,698.75	1,469.31	326,964.52	61,200.00	1,468.79
05/09/2545	1,010.71	1,068.01	656	365	1,052,957.59	926,506.56	123,465.00	2,986.02	599,459.37	62,265.00	1,501.38	327,047.20	61,200.00	1,484.64
28/02/2546	1,025.82	1,083.64	656	365	1,068,577.55	940,256.43	123,465.00	4,856.12	608,423.99	62,265.00	2,454.30	331,832.44	61,200.00	2,401.82

ตารางผนวก ค10

การแสดงผลการดำเนินงานของ Random Portfolio (1)

วันที่	อัตราผลตอบแทน (Yield) (%)		ราคาตลาด (บาทต่อหน่วย)		จำนวนหน่วย		มูลค่าของ Portfolios (บาท)			ดอกเบี้ยรับรวม	ผลตอบแทน การลงทุนต่อ รวม	มูลค่าเงินลงทุนและ ผลตอบแทนรวม ทั้งหมด	อัตรา ผลตอบแทนที่ ได้รับจริง(Ri)	อัตราดอกเบี้ยเงิน ฝากประจำ 12 เดือนเฉลี่ย(Rf)	อัตราเฉลี่ย (Ri - Rf)	ค่าส่วน เบี่ยงเบน มาตรฐาน
	LB033A	LB038A	LB033A	LB038A	LB033A	LB038A	LB033A	LB038A	รวม							
03/01/2544	3.093622	3.127143	1,062.21	1,208.28	593	306	630,000.00	370,000.00	1,000,000.00	0.00	0.00	1,000,000.00				
28/02/2544	2.250000	2.350000	1,084.20	1,184.50	593	306	643,045.00	362,717.64	1,005,762.64	15,300.00	0.00	1,021,062.64				
05/03/2544	2.230000	2.321667	1,058.66	1,185.71	593	306	627,894.59	363,089.18	990,983.77	30,866.25	8.80	1,021,858.82				
30/03/2544	2.520000	2.655000	1,054.62	1,178.96	593	306	625,501.33	361,020.82	986,522.15	30,866.25	82.80	1,017,471.19	7.537108	3.20	4.337108	19.189901
29/06/2544	3.940000	4.158000	1,037.58	1,152.79	786	133	815,053.32	153,349.66	968,402.99	30,866.25	352.14	999,621.37	-6.852936	3.00	-9.852936	100.188411
31/08/2544	3.493333	3.796667	1,051.21	1,118.57	786	133	825,756.87	148,796.87	974,553.74	37,516.25	538.60	1,012,608.59				
05/09/2544	3.473333	3.760000	1,025.90	1,119.89	786	133	805,874.16	148,972.82	954,846.98	58,148.75	556.59	1,013,552.32				
28/09/2544	3.201667	3.490000	1,031.96	1,127.86	786	133	810,641.63	150,033.20	960,674.82	58,148.75	684.84	1,019,508.41	8.221895	3.00	5.221895	25.658428
28/12/2544	2.551429	2.652857	1,047.84	1,152.18	868	58	909,665.84	66,714.17	976,380.02	58,148.75	1,192.24	1,035,721.01	6.532765	2.95	3.581666	11.399300
28/02/2545	2.209286	2.325714	1,055.84	1,112.38	868	58	916,613.22	64,409.93	981,023.14	61,048.75	1,536.48	1,043,608.38				
05/03/2545	2.224000	2.362000	1,029.67	1,112.17	868	58	893,890.90	64,397.44	958,288.33	83,833.75	1,564.73	1,043,686.81				
29/03/2545	2.144286	2.308571	1,031.92	1,114.68	868	58	895,845.54	64,543.22	960,388.77	83,833.75	1,741.20	1,045,963.72	4.026097	2.71	1.311262	0.756234
28/06/2545	2.085714	2.187143	1,037.83	1,122.58	931	0	965,975.26	-	965,975.26	83,833.75	2,410.32	1,052,219.33	2.420545	2.60	-0.179455	0.541600
02/09/2545	1.897143	1.982857	1,042.69	1,079.20	931	0	970,504.00	-	970,504.00	83,833.75	2,894.34	1,057,232.09				
05/09/2545	1.870000	1.951667	1,016.82	1,079.69	931	0	946,421.66	-	946,421.66	108,272.50	2,916.18	1,057,610.34				
30/09/2545	1.934286	1.987143	1,017.84	1,080.79	931	0	947,371.12	-	947,371.12	108,272.50	3,142.84	1,058,786.46	2.445343	2.60	-0.154657	0.505716
27/12/2545	1.700833	1.743333	1,023.02	1,087.66	931	0	952,188.48	-	952,188.48	108,272.50	3,940.68	1,064,401.66	2.218149	2.17	0.049967	0.880465
28/02/2546	1.460000	1.478333	1,026.05	1,042.23	931	0	955,007.30	-	955,007.30	108,272.50	4,511.87	1,067,791.67	1.859355	2.00	-0.140645	1.682534
													3.156480	2.69	0.463801	4.483338

ตารางผนวก ค11

การคำนวณดอกเบี้ยรับและผลตอบแทนจากการลงทุนต่อในเงินฝากประจำ 12 เดือน

ของ Random Portfolio (1)

วันที่	ดอกเบี้ยรับ(Coupon)		อัตราดอกเบี้ย เงินฝากประจำ 12 เดือน	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน จากการ ลงทุนต่อ	ดอกเบี้ยรับและ ผลตอบแทนจาก การลงทุนต่อ
	LB033A	LB08DA				
28/02/2544		15,300.00	3.50	15,300.00	0.00	15,300.00
05/03/2544	15,566.25		3.50	30,866.25	8.80	30,875.05
30/03/2544				30,866.25	82.80	30,949.05
29/06/2544				30,866.25	352.14	31,218.39
31/08/2544		6,650.00	3.50	37,516.25	538.60	38,054.85
05/09/2544	20,632.50		3.50	58,148.75	556.59	58,705.34
28/09/2544				58,148.75	684.84	58,833.59
28/12/2544				58,148.75	1,192.24	59,340.99
28/02/2545		2,900.00	3.00	61,048.75	1,536.48	62,585.23
05/03/2545	22,785.00		3.00	83,833.75	1,564.73	85,398.48
29/03/2545				83,833.75	1,741.20	85,574.95
28/06/2545				83,833.75	2,410.32	86,244.07
02/09/2545		0.00	3.00	83,833.75	2,894.34	86,728.09
05/09/2545	24,438.75		3.00	108,272.50	2,916.18	111,188.68
30/09/2545				108,272.50	3,142.84	111,415.34
27/12/2545				108,272.50	3,940.68	112,213.18
28/02/2546				108,272.50	4,511.87	112,784.37

ตารางผนวก ค12

การจัดสรรน้ำหนักของแต่ละพันธบัตรใน Random Portfolio (1)

วันที่	ระยะเวลา การลงทุน (ปี)	Duration ของ Portfolio	Random Portfolios (1)	
			LB033A	LB038A
3/01/2544	2.16	2.16	0.630000	0.370000
29/06/2544	1.67	1.67	0.841647	0.158353
28/12/2544	1.17	1.17	0.931672	0.068328
28/06/2545	0.67	0.68	1.000000	0.000000
27/12/2545	0.17	0.19	1.000000	0.000000
28/02/2546	0.00	0.01	1.000000	0.000000

ตารางผนวก ค13

กระแสเงินสดหรือผลตอบแทนรวมที่คาดหวังจากการลงทุนของ Random Portfolio (2)

อัตราผลตอบแทน(Yield) 3.10%

วันที่	ราคาตลาด (บาทต่อหน่วย)		จำนวนหน่วย		มูลค่าของกลุ่มหลักทรัพย์ (บาท)									
	LB033A	LB08DA	LB033A	LB08DA	ผลตอบแทนรวม	ผลตอบแทน จากราคารวม	ดอกเบี้ยรับ รวม	ผลตอบแทน ลงทุนต่อรวม	LB033A			LB08DA		
									ผลตอบแทน จากราคา	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน ลงทุนต่อ	ผลตอบแทน จากราคา	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน ลงทุนต่อ
03/01/2544	1,065.69	1,241.05	910	24	1,000,000.00	1,000,000.00	-	-	970,000.00			30,000.00		
05/03/2544	1,041.25	1,390.22	933	24	1,005,254.11	981,366.61	23,887.50	-	947,760.52	23,887.50	-	33,606.08	-	-
08/06/2544	1,049.62	1,358.84	933	25	1,013,326.34	988,226.82	24,907.50	192.03	955,379.33	23,887.50	192.03	32,847.49	1,020.00	-
05/09/2544	1,031.41	1,369.07	957	25	1,021,073.46	971,892.92	48,795.00	385.54	938,798.12	47,775.00	377.86	33,094.80	1,020.00	7.68
11/12/2544	1,039.87	1,337.86	957	26	1,029,459.49	978,844.61	49,815.00	799.88	946,504.39	47,775.00	773.13	32,340.21	2,040.00	26.75
05/03/2545	1,020.88	1,347.36	982	26	1,036,652.57	961,788.39	73,702.50	1,161.68	929,218.41	71,662.50	1,120.25	32,569.98	2,040.00	41.43
10/06/2545	1,029.26	1,315.86	982	27	1,045,172.50	968,654.53	74,722.50	1,795.46	936,846.07	71,662.50	1,717.70	31,808.46	3,060.00	77.77
05/09/2545	1,010.71	1,325.54	1007	27	1,053,002.62	952,006.40	98,610.00	2,386.22	919,963.85	95,550.00	2,285.37	32,042.55	3,060.00	100.86
09/12/2545	1,018.84	1,293.75	1007	27	1,061,487.58	958,633.20	99,630.00	3,224.38	927,359.19	95,550.00	3,071.84	31,274.01	4,080.00	152.54
28/02/2546	1,025.82	1,302.61	1007	27	1,068,577.55	965,018.61	99,630.00	3,928.94	933,530.38	95,550.00	3,747.40	31,488.23	4,080.00	181.54

ตารางผนวก ค14

การแสดงผลการดำเนินงานของ Random Portfolio (2)

วันที่	อัตราผลตอบแทน (Yield) (%)		ราคาตลาด (บาทต่อหน่วย)		จำนวนหน่วย		มูลค่าของ Portfolios (บาท)			ดอกเบี้ยรับรวม	ผลตอบแทน การลงทุนต่อ รวม	มูลค่าเงินลงทุนและ ผลตอบแทนรวม ทั้งหมด	อัตรา ได้รับจริง(Ri)	อัตราดอกเบี้ยเงิน ฝากประจำ 12 เดือนเฉลี่ย(Rf)	อัตราเฉลี่ย (Ri - Rf)	ค่าส่วน เบี่ยงเบน มาตรฐาน
	LB033A	LB08DA	LB033A	LB08DA	LB033A	LB08DA	LB033A	LB08DA	รวม							
03/01/2544	2.931619	4.887143	1,065.69	1,241.05	910	24	970,000.00	30,000.00	1,000,000.00	0.00	0.00	1,000,000.00				
05/03/2544	2.230000	3.995000	1,058.66	1,318.34	910	24	963,602.13	31,868.42	995,470.55	23,887.50	0.00	1,019,358.05				
30/03/2544	2.520000	4.495000	1,054.62	1,284.11	910	24	959,929.30	31,040.99	990,970.28	23,887.50	57.26	1,014,915.05	6.408217	3.20	3.208217	11.188390
08/06/2544	3.660000	5.418000	1,040.01	1,187.81	910	24	946,633.89	28,713.06	975,346.95	24,907.50	217.61	1,000,472.06				
29/06/2544	3.940000	5.496000	1,037.58	1,186.23	925	11	959,612.31	13,481.24	973,093.55	24,907.50	267.76	998,268.81	-6.418003	3.00	-9.418003	89.895332
05/09/2544	3.473333	5.900000	1,025.90	1,172.17	925	11	948,805.12	13,321.44	962,126.55	49,188.75	430.17	1,011,745.48				
28/09/2544	3.201667	5.448333	1,031.96	1,205.47	925	11	954,418.15	13,699.98	968,118.13	49,188.75	538.66	1,017,845.53	8.101118	3.00	5.101118	25.379490
11/12/2544	2.692000	4.224000	1,044.87	1,257.31	925	11	966,356.15	14,289.05	980,645.20	49,656.25	887.69	1,031,189.15				
28/12/2544	2.551429	3.950000	1,047.84	1,278.71	934	4	978,362.55	5,270.30	983,632.85	49,656.25	968.64	1,034,257.74	6.626208	2.95	3.675109	12.694229
05/03/2545	2.224000	4.504000	1,029.67	1,250.93	934	4	961,396.30	5,155.83	966,552.13	74,173.75	1,287.67	1,042,013.54				
29/03/2545	2.144286	4.754286	1,031.92	1,238.48	934	4	963,498.56	5,104.49	968,603.05	74,173.75	1,444.10	1,044,220.90	3.920247	2.71	1.205412	0.734338
10/06/2545	2.050000	4.381250	1,037.03	1,231.02	934	4	968,272.86	5,073.73	973,346.59	74,343.75	1,919.73	1,049,610.07				
28/06/2545	2.085714	4.323571	1,037.83	1,237.30	939	0	974,115.12	-	974,115.12	74,343.75	2,037.11	1,050,495.99	2.432237	2.60	-0.167763	0.398256
05/09/2545	1.870000	3.311667	1,016.82	1,311.59	939	0	954,396.76	-	954,396.76	98,992.50	2,487.07	1,055,876.33				
30/09/2545	1.934286	3.173571	1,017.84	1,323.52	939	0	955,354.21	-	955,354.21	98,992.50	2,694.18	1,057,040.89	2.441026	2.60	-0.158974	0.387240
09/12/2545	1.705833	2.756667	1,022.15	1,315.76	939	0	959,399.31	-	959,399.31	98,992.50	3,274.17	1,061,665.97				
27/12/2545	1.700833	2.655000	1,023.02	1,324.09	939	0	960,212.17	-	960,212.17	98,992.50	3,423.19	1,062,627.86	2.210578	2.17	0.042396	0.727155
28/02/2546	1.460000	2.335833	1,026.05	1,350.31	939	0	963,054.74	-	963,054.74	98,992.50	3,944.78	1,065,992.03	1.848179	2.00	-0.151821	1.476548
													3.063312	2.69	0.370632	4.226124

ตารางผนวก ค15

การคำนวณดอกเบี้ยรับและผลตอบแทนจากการลงทุนต่อในเงินฝากประจำ 12 เดือน

ของ Random Portfolio (2)

วันที่	ดอกเบี้ยรับ(Coupon)		อัตราดอกเบี้ย เงินฝากประจำ 12 เดือน	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน จากการ ลงทุนต่อ	ดอกเบี้ยรับและ ผลตอบแทนจาก การลงทุนต่อ
	LB033A	LB08DA				
05/03/2544	23,887.50	1,020.00	3.50	23,887.50	0.00	23,887.50
30/03/2544				23,887.50	57.26	23,944.76
08/06/2544			3.50	24,907.50	217.61	25,125.11
29/06/2544				24,907.50	267.76	25,175.26
05/09/2544	24,281.25	467.50	3.50	49,188.75	430.17	49,618.92
28/09/2544				49,188.75	538.66	49,727.41
11/12/2544			3.50	49,656.25	887.69	50,543.94
28/12/2544				49,656.25	968.64	50,624.89
05/03/2545	24,517.50	170.00	3.00	74,173.75	1,287.67	75,461.42
29/03/2545				74,173.75	1,444.10	75,617.85
10/06/2545			3.00	74,343.75	1,919.73	76,263.48
28/06/2545				74,343.75	2,037.11	76,380.86
05/09/2545	24,648.75	0.00	3.00	98,992.50	2,487.07	101,479.57
30/09/2545				98,992.50	2,694.18	101,686.68
09/12/2545			3.00	98,992.50	3,274.17	102,266.67
27/12/2545				98,992.50	3,423.19	102,415.69
28/02/2546				98,992.50	3,944.78	102,937.28

ตารางผนวก ค16

การจัดสรรน้ำหนักของแต่ละพันธบัตรใน Random Portfolio (2)

วันที่	ระยะเวลา การลงทุน (ปี)	Duration ของ Portfolio	Random Portfolios (2)	
			LB033A	LB08DA
3/01/2544	2.16	2.16	0.970000	0.030000
29/06/2544	1.67	1.67	0.986146	0.013854
28/12/2544	1.17	1.17	0.994642	0.005358
28/06/2545	0.67	0.68	1.000000	0.000000
27/12/2545	0.17	0.19	1.000000	0.000000
28/02/2546	0.00	0.01	1.000000	0.000000