

ตารางผนวก ง1

กระแสเงินสดหรือผลตอบแทนรวมที่คาดหวังจากการลงทุนของ Minimum M-Absolute Portfolio

อัตราผลตอบแทน(Yield) 1.45%

วันที่	ราคาตลาด (บาทต่อหน่วย)		จำนวนหน่วย		มูลค่าของกลุ่มหลักทรัพย์ (บาท)									
	LB06DA	LB082A	LB06DA	LB082A	ผลตอบแทนรวม	ผลตอบแทน จากราคารวม	ดอกเบี้ยรับรวม	ผลตอบแทน ลงทุนต่อรวม	LB06DA			LB082A		
									ผลตอบแทนจาก ราคา	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน ลงทุนต่อ	ผลตอบแทน จากราคา	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน ลงทุนต่อ
02/07/2546	1,225.14	1,131.87	580	256	1,000,000.00	1,000,000.00	-	-	710,000.00	-	-	290,000.00	-	-
13/08/2546	1,225.92	1,116.10	580	261	1,001,692.79	996,412.79	5,280.00	-	710,451.60	-	-	285,961.18	5,280.00	-
08/12/2546	1,191.63	1,121.28	599	261	1,006,379.62	977,870.68	28,480.00	28.94	690,582.08	23,200.00	-	287,288.59	5,280.00	28.94
12/02/2547	1,194.75	1,103.66	599	266	1,009,010.28	975,161.04	33,760.00	89.24	692,388.56	23,200.00	41.69	282,772.48	10,560.00	47.56
08/06/2547	1,160.22	1,108.74	620	266	1,013,640.14	956,454.52	56,960.00	225.62	672,380.68	46,400.00	129.25	284,073.84	10,560.00	96.37
13/08/2547	1,163.26	1,090.95	620	271	1,016,274.26	953,655.26	62,240.00	379.00	674,139.54	46,400.00	250.96	279,515.72	15,840.00	128.03
08/12/2547	1,128.64	1,096.01	642	271	1,020,977.88	934,888.06	85,440.00	649.82	654,074.85	69,600.00	447.66	280,813.21	15,840.00	202.15
14/02/2548	1,131.68	1,078.36	642	276	1,023,735.01	932,128.46	90,720.00	886.56	655,837.75	69,600.00	636.46	276,290.71	21,120.00	250.09
08/06/2548	1,096.82	1,083.28	665	276	1,028,391.75	913,187.56	113,920.00	1,284.20	635,636.30	92,800.00	936.61	277,551.25	21,120.00	347.59
15/08/2548	1,099.78	1,065.51	665	281	1,031,145.40	910,347.58	119,200.00	1,597.82	637,349.51	92,800.00	1,189.25	272,998.07	26,400.00	408.57
08/12/2548	1,064.82	1,070.37	690	281	1,035,863.89	891,332.10	142,400.00	2,131.79	617,088.51	116,000.00	1,600.91	274,243.59	26,400.00	530.88
14/02/2549	1,067.69	1,052.69	690	287	1,038,672.93	888,465.65	147,680.00	2,527.28	618,751.71	116,000.00	1,917.88	269,713.93	31,680.00	609.41
08/06/2549	1,032.49	1,057.45	717	287	1,043,356.36	869,290.95	170,880.00	3,185.41	598,357.20	139,200.00	2,429.97	270,933.75	31,680.00	755.44
15/08/2549	1,035.28	1,039.61	717	293	1,046,150.06	866,333.06	176,160.00	3,657.00	599,969.93	139,200.00	2,811.70	266,363.13	36,960.00	845.31
30/11/2549	1,039.67	1,044.02	717	293	1,050,598.13	870,017.92	176,160.00	4,420.20	602,524.26	139,200.00	3,414.44	267,493.66	36,960.00	1,005.77

ตารางผนวก 2

การแสดงผลการดำเนินงานของ Minimum M-Absolute Portfolio

วันที่	อัตราผลตอบแทน(Yield) (%)		ราคาตลาด (บาทต่อหน่วย)		จำนวนหน่วย		มูลค่าของกลุ่มหลักทรัพย์ (บาท)			ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน การลงทุนต่อ รวม	มูลค่าเงินลงทุน และผลตอบแทน รวมทั้งหมด	อัตรา ผลตอบแทนที่ ได้รับจริง(Ri)	อัตราดอกเบี้ยเงิน ฝากประจำ 12 เดือนเฉลี่ย(Rf)	อัตราเฉลี่ย (Ri - Rf)	ค่าส่วน เบี่ยงเบน มาตรฐาน
	LB06DA	LB082A	LB06DA	LB082A	LB06DA	LB082A	LB06DA	LB082A	รวม							
02/07/2546	1.416633	1.514167	1,225.14	1,131.87	580	256	710,000.00	290,000.00	1,000,000.00	0.00	0.00	1,000,000.00				
13/08/2546	1.408571	1.635714	1,227.42	1,107.55	580	256	711,324.10	283,768.92	995,093.03	5,284.41	0.00	1,000,377.44				
30/09/2546	1.516667	1.820000	1,225.93	1,101.75	580	256	710,460.63	282,284.66	992,745.29	5,284.41	10.42	998,040.13	-0.792461	1.07	-1.858222	5.086260
08/12/2546	2.392000	2.952000	1,161.45	1,058.95	580	256	673,093.01	271,317.77	944,410.78	28,465.46	25.41	972,901.65				
31/12/2546	2.084000	2.588000	1,172.75	1,075.41	641	190	751,259.07	203,914.21	955,173.28	28,465.46	52.31	983,691.06	-5.583482	1.01	-6.592721	49.650269
12/02/2547	1.730000	2.214167	1,186.25	1,072.86	641	190	759,909.56	203,430.23	963,339.79	32,376.27	102.62	995,818.67				
31/03/2547	1.553333	2.025000	1,193.98	1,083.19	641	190	764,861.20	205,390.00	970,251.20	32,376.27	166.41	1,002,793.88	8.112499	1.00	7.112499	44.218328
08/06/2547	2.105714	3.080000	1,142.78	1,049.32	641	190	732,063.28	198,966.90	931,030.18	58,000.17	260.07	989,290.42				
30/06/2547	2.180000	3.056667	1,142.32	1,052.07	702	123	801,859.85	129,394.00	931,253.85	58,000.17	316.95	989,570.98	-5.184849	1.00	-6.184849	44.191406
13/08/2547	2.530000	3.100000	1,136.83	1,033.71	702	123	798,005.11	127,136.09	925,141.20	60,536.85	430.73	986,108.78				
30/09/2547	2.371667	3.048333	1,144.20	1,039.57	702	123	803,177.69	127,857.45	931,035.14	60,536.85	562.61	992,134.60	1.031767	1.00	0.031767	0.185800
08/12/2547	2.662000	3.204000	1,103.26	1,040.77	702	123	774,442.38	128,004.86	902,447.23	88,615.18	752.19	991,814.60				
30/12/2547	2.758333	3.246667	1,103.09	1,041.49	754	68	831,332.39	71,087.20	902,419.59	88,615.18	846.11	991,880.88	-0.102537	1.00	-1.102537	2.450320
14/02/2548	2.841667	3.333333	1,105.36	1,022.66	754	68	833,037.05	69,801.70	902,838.75	90,022.94	1,042.11	993,903.81				
31/03/2548	2.791667	3.210000	1,110.16	1,030.32	754	68	836,657.19	70,325.01	906,982.20	90,022.94	1,243.45	998,248.59	2.571361	1.00	1.571361	1.228879
08/06/2548	3.013333	3.315000	1,072.56	1,033.83	754	68	808,318.38	70,564.76	878,883.14	120,168.40	1,544.22	1,000,595.76				
30/06/2548	2.971667	3.230000	1,075.10	1,038.03	794	26	853,734.62	27,354.29	881,088.91	120,168.40	1,689.72	1,002,947.03	1.901266	1.02	0.884233	0.192241
15/08/2548	3.722857	4.107143	1,069.11	1,000.59	794	26	848,973.60	26,367.60	875,341.20	120,711.92	1,992.82	998,045.94				
30/09/2548	3.820000	4.530000	1,072.93	996.32	794	26	852,007.79	26,255.13	878,262.92	120,711.92	2,304.50	1,001,279.34	-0.658069	1.40	-2.053721	4.498139

ตารางผนวก ง2 (ต่อ)

การแสดงผลการดำเนินงานของ Minimum M-Absolute Portfolio

วันที่	อัตราผลตอบแทน(Yield) (%)		ราคาตลาด (บาทต่อหน่วย)		จำนวนหน่วย		มูลค่าของกลุ่มหลักทรัพย์ (บาท)			ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน การลงทุนต่อ รวม	มูลค่าเงินลงทุน และผลตอบแทน รวมทั้งหมด	อัตรา ผลตอบแทนที่ ได้รับจริง(Ri)	อัตราดอกเบี้ยเงิน ฝากประจำ 12 เดือนเฉลี่ย(Rf)	อัตราเฉลี่ย (Ri - Rf)	ค่าส่วน เบี่ยงเบน มาตรฐาน
	LB06DA	LB082A	LB06DA	LB082A	LB06DA	LB082A	LB06DA	LB082A	รวม							
08/12/2548	4.596667	5.275000	1,032.96	989.70	794	26	820,267.47	26,080.78	846,348.25	152,475.70	2,769.56	1,001,593.51				
30/12/2548	4.477143	4.967143	1,036.91	998.85	819	0	849,723.67	-	849,723.67	152,475.70	3,029.27	1,005,228.64	1.591458	2.27	-0.675575	0.016550
14/02/2549	4.537143	4.951429	1,042.22	984.91	819	0	854,080.82	-	854,080.82	152,475.70	3,572.02	1,010,128.54				
31/03/2549	4.817143	5.222857	1,046.08	986.14	819	0	857,244.91	-	857,244.91	152,475.70	4,115.38	1,013,835.99	3.478970	3.05	0.426223	4.064890
08/06/2549	4.983333	5.258333	1,014.65	995.24	819	0	831,483.61	-	831,483.61	185,254.89	4,948.53	1,021,687.03				
30/06/2549	5.125714	5.367143	1,017.04	996.71	819	0	833,443.47	-	833,443.47	185,254.89	5,412.68	1,024,111.03	4.127511	3.95	0.175313	7.100617
15/08/2549	4.991429	5.246429	1,023.97	984.23	819	0	839,122.72	-	839,122.72	185,254.89	6,383.16	1,030,760.77				
29/09/2549	4.943333	5.000833	1,030.31	993.73	819	0	844,314.63	-	844,314.63	185,254.89	7,359.62	1,036,929.15	5.115684	4.00	1.115684	13.343469
30/11/2549	4.768000	4.746000	1,038.93	1,005.03	819	0	851,379.13	-	851,379.13	185,254.89	8,704.97	1,045,339.00	4.870260	4.00	0.870260	11.610697
													1.462813	1.91	-0.448592	3.801193

ตารางผนวก ง3

การคำนวณดอกเบี้ยรับและผลตอบแทนจากการลงทุนต่อในเงินฝากประจำ 12 เดือน

ของ Minimum M-Absolute Portfolio

วันที่	ดอกเบี้ยรับ(Coupon)		อัตราดอกเบี้ยเงิน ฝากประจำ 12 เดือน	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทนจาก การลงทุนต่อ	ดอกเบี้ยรับและ ผลตอบแทนจาก การลงทุนต่อ
	LB06DA	LB082A				
13/08/2546		5,284.41	1.50	5,284.41	0.00	5,284.41
30/09/2546				5,284.41	10.42	5,294.84
08/12/2546	23,181.05		1.50	28,465.46	25.41	28,490.87
31/12/2546				28,465.46	52.31	28,517.78
12/02/2547		3,910.81	1.75	32,376.27	102.62	32,478.89
31/03/2547				32,376.27	166.41	32,542.68
08/06/2547	25,623.90		1.75	58,000.17	260.07	58,260.24
30/06/2547				58,000.17	316.95	58,317.13
13/08/2547		2,536.68	1.75	60,536.85	430.73	60,967.58
30/09/2547				60,536.85	562.61	61,099.46
08/12/2547	28,078.33		1.75	88,615.18	752.19	89,367.37
30/12/2547				88,615.18	846.11	89,461.29
14/02/2548		1,407.77	2.00	90,022.94	1,042.11	91,065.06
31/03/2548				90,022.94	1,243.45	91,266.39
08/06/2548	30,145.46		2.25	120,168.40	1,544.22	121,712.62
30/06/2548				120,168.40	1,689.72	121,858.13
15/08/2548		543.51	2.30	120,711.92	1,992.82	122,704.73
30/09/2548				120,711.92	2,304.50	123,016.42
08/12/2548	31,763.79		3.25	152,475.70	2,769.56	155,245.26
30/12/2548				152,475.70	3,029.27	155,504.98
14/02/2549		0.00	3.75	152,475.70	3,572.02	156,047.72
31/03/2549				152,475.70	4,115.38	156,591.08
08/06/2549	32,779.19		5.05	185,254.89	4,948.53	190,203.42
30/06/2549				185,254.89	5,412.68	190,667.57
15/08/2549		0.00	4.75	185,254.89	6,383.16	191,638.05
29/09/2549				185,254.89	7,359.62	192,614.51
30/11/2549				185,254.89	8,704.97	193,959.86

ตารางผนวก 4
การจัดสรรน้ำหนักของแต่ละพันธบัตรใน Minimum M-Absolute Portfolio

วันที่	ระยะเวลา การลงทุน (ปี)	Duration ของ Portfolio	Minimum M-Absolute Portfolios		M-Absolute ของ Portfolios
			LB06DA	LB082A	
2/07/2546	3.42	3.42	0.710000	0.290000	0.610000
31/12/2546	2.92	2.92	0.786516	0.213484	0.463805
30/06/2547	2.42	2.42	0.861054	0.138946	0.325175
30/12/2547	1.92	1.92	0.921226	0.078774	0.204972
30/06/2548	1.42	1.42	0.968954	0.031046	0.106181
30/12/2548	0.92	0.92	1.000000	0.000000	0.036450
30/06/2549	0.42	0.44	1.000000	0.000000	0.021096
30/11/2549	0.00	0.02	1.000000	0.000000	

ตารางผนวก ง5

กระแสเงินสดหรือผลตอบแทนรวมที่คาดหวังจากการลงทุนของ Minimum M-Square Portfolio

อัตราผลตอบแทน(Yield) 1.45%

วันที่	ราคาตลาด (บาทต่อหน่วย)		จำนวนหน่วย		มูลค่าของกลุ่มหลักทรัพย์ (บาท)									
	LB06DA	LB077A	LB06DA	LB077A	ผลตอบแทนรวม	ผลตอบแทน จากราคารวม	ดอกเบี้ยรับ รวม	ผลตอบแทน ลงทุนต่อรวม	LB06DA			LB077A		
									ผลตอบแทน จากราคา	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน ลงทุนต่อ	ผลตอบแทน จากราคา	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน ลงทุนต่อ
02/07/2546	1,226.14	1,187.23	285	547	1,000,000.00	1,000,000.00	-	-	350,000.00			650,000.00		
07/07/2546	1,224.12	1,160.64	285	561	1,000,185.09	984,869.09	15,316.00	-	349,423.57	-	-	635,445.52	15,316.00	-
08/12/2546	1,191.63	1,167.74	295	561	1,006,289.40	979,479.75	26,716.00	93.65	340,148.89	11,400.00	-	639,330.86	15,316.00	93.65
07/01/2547	1,193.05	1,141.20	295	574	1,007,531.73	965,350.83	42,032.00	148.91	340,553.05	11,400.00	13.55	624,797.77	30,632.00	135.36
08/06/2547	1,160.22	1,148.08	305	574	1,013,604.53	959,751.96	53,432.00	420.57	331,183.72	22,800.00	99.53	628,568.25	30,632.00	321.03
07/07/2547	1,161.56	1,121.33	305	589	1,014,717.73	945,488.00	68,748.00	481.73	331,564.10	22,800.00	125.84	613,923.90	45,948.00	355.89
08/12/2547	1,128.64	1,128.19	316	589	1,020,907.86	939,844.76	80,148.00	915.09	322,167.11	34,200.00	276.09	617,677.65	45,948.00	639.01
07/01/2548	1,129.98	1,101.55	316	604	1,022,139.68	925,643.58	95,464.00	1,032.09	322,549.91	34,200.00	317.05	603,093.68	61,264.00	715.04
08/06/2548	1,096.82	1,108.24	328	604	1,028,342.05	919,842.32	106,864.00	1,635.73	313,085.13	45,600.00	544.20	606,757.18	61,264.00	1,091.54
07/07/2548	1,098.08	1,081.45	328	619	1,029,491.13	905,533.82	122,180.00	1,777.31	313,444.73	45,600.00	597.19	592,089.09	76,580.00	1,180.12
08/12/2548	1,064.82	1,088.07	340	619	1,035,811.96	899,658.68	133,580.00	2,573.28	303,949.35	57,000.00	917.71	595,709.33	76,580.00	1,655.57
09/01/2549	1,066.17	1,061.51	340	636	1,037,151.33	885,502.40	148,896.00	2,752.93	304,334.58	57,000.00	991.12	581,167.82	91,896.00	1,761.81
08/06/2549	1,032.49	1,067.83	353	636	1,043,327.09	879,351.88	160,296.00	3,679.21	294,723.17	68,400.00	1,359.66	584,628.71	91,896.00	2,319.55
07/07/2549	1,033.68	1,040.99	353	653	1,044,493.81	864,998.19	175,612.00	3,883.62	295,061.67	68,400.00	1,439.78	569,936.52	107,212.00	2,443.83
30/11/2549	1,039.67	1,047.02	353	653	1,050,598.13	870,062.19	175,612.00	4,923.94	296,822.43	68,400.00	1,844.56	573,239.76	107,212.00	3,079.38

ตารางผนวก 6

การแสดงผลการดำเนินงานของ Minimum M-Square Portfolio

วันที่	อัตราผลตอบแทน(Yield) (%)		ราคาคาด (บาทต่อหน่วย)		จำนวนหน่วย		มูลค่าของกลุ่มหลักทรัพย์ (บาท)			ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน การลงทุนต่อ รวม	มูลค่าเงินลงทุนและ ผลตอบแทนรวม ทั้งหมด	อัตรา ได้รับจริง(Ri)	อัตราดอกเบี้ยเงิน ฝากประจำ 12 เดือน(Rf)	อัตราเฉลี่ย (Ri - Rf)	ค่าส่วน เบี่ยงเบน มาตรฐาน
	LB06DA	LB077A	LB06DA	LB077A	LB06DA	LB077A	LB06DA	LB077A	รวม							
02/07/2546	1.390000	1.479470	1,226.14	1,187.23	285	547	350,000.00	650,000.00	1,000,000.00	0.00	0.00	1,000,000.00				
07/07/2546	1.406667	1.520000	1,225.75	1,157.69	285	547	349,887.70	633,825.68	983,713.39	15,316.00	0.00	999,029.39				
30/09/2546	1.516667	1.683333	1,225.93	1,155.32	285	547	349,940.15	632,529.52	982,469.67	15,316.00	62.42	997,848.08	-0.869858	1.07	-1.935619	5.490094
08/12/2546	2.392000	2.636000	1,161.45	1,124.06	285	547	331,534.58	615,415.15	946,949.73	26,716.00	113.09	973,778.82				
31/12/2546	2.084000	2.384000	1,172.75	1,134.86	430	398	504,529.30	451,560.04	956,089.33	26,716.00	140.75	982,946.09	-5.794949	1.01	-6.804188	52.826526
07/01/2547	1.988571	2.305714	1,176.17	1,110.27	430	398	506,002.97	441,772.85	947,775.82	37,860.00	149.17	985,784.99				
31/03/2547	1.553333	1.758333	1,193.98	1,134.44	430	398	513,664.19	451,391.64	965,055.83	37,860.00	293.35	1,003,209.19	8.627450	1.00	7.627450	51.182766
08/06/2547	2.105714	2.427143	1,142.78	1,117.13	430	398	491,637.82	444,502.56	936,140.39	55,060.00	413.21	991,613.60				
30/06/2547	2.180000	2.583333	1,142.32	1,114.00	568	257	648,497.53	286,198.23	934,695.76	55,060.00	469.57	990,225.34	-5.090877	1.00	-6.090877	43.087591
07/07/2547	2.184286	2.577143	1,142.68	1,086.62	568	257	648,705.35	279,164.24	927,869.60	62,256.00	487.51	990,613.10				
30/09/2547	2.371667	2.670000	1,144.20	1,090.53	568	257	649,563.32	280,169.74	929,733.06	62,256.00	735.68	992,724.73	1.005153	1.00	0.005153	0.219102
08/12/2547	2.662000	2.878000	1,103.26	1,090.64	568	257	626,323.87	280,198.48	906,522.35	84,976.00	937.13	992,435.48				
30/12/2547	2.758333	2.958333	1,103.09	1,090.51	681	142	751,121.00	155,272.45	906,393.45	84,976.00	1,027.23	992,396.68	-0.132481	1.00	-1.132481	2.578330
07/01/2548	2.756000	2.966000	1,103.80	1,063.06	681	142	751,603.50	151,364.61	902,968.11	88,952.00	1,059.99	992,980.09				
31/03/2548	2.791667	3.070000	1,110.16	1,067.94	681	142	755,932.04	152,059.86	907,991.90	88,952.00	1,429.60	998,373.50	2.410839	1.00	1.410839	0.879098
08/06/2548	3.013333	3.211667	1,072.56	1,071.19	681	142	730,327.51	152,522.51	882,850.02	116,192.00	1,732.38	1,000,774.40				
30/06/2548	2.971667	3.125000	1,075.10	1,074.99	768	55	825,989.04	59,135.15	885,124.18	116,192.00	1,871.72	1,003,187.90	1.948286	1.02	0.931253	0.225672
07/07/2548	3.035000	3.180000	1,074.80	1,046.40	768	55	825,751.77	57,562.63	883,314.40	117,732.00	1,914.96	1,002,961.36				
30/09/2548	3.820000	4.304000	1,072.93	1,034.61	768	55	824,318.33	56,914.25	881,232.58	117,732.00	2,489.99	1,001,454.56	-0.683742	1.40	-2.079394	4.652558

ตารางผนวก ง6 (ต่อ)

การแสดงผลการดำเนินงานของ Minimum M-Square Portfolio

วันที่	อัตราผลตอบแทน(Yield) (%)		ราคาลาด (บาทต่อหน่วย)		จำนวนหน่วย		มูลค่าของกลุ่มหลักทรัพย์ (บาท)			ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน การลงทุนต่อ รวม	มูลค่าเงินลงทุนและ ผลตอบแทนรวม ทั้งหมด	อัตรา ผลตอบแทนที่ ได้รับจริง(Ri)	อัตราดอกเบี้ยเงิน ฝากประจำ 12 เดือนเฉลี่ย(Rf)	อัตราเฉลี่ย (Ri - Rf)	ค่าส่วน เบี่ยงเบน มาตรฐาน
	LB06DA	LB077A	LB06DA	LB077A	LB06DA	LB077A	LB06DA	LB077A	รวม							
08/12/2548	4.596667	5.081667	1,032.96	1,031.13	768	55	793,609.54	56,722.87	850,332.40	148,452.00	2,955.13	1,001,739.54				
30/12/2548	4.477143	4.838571	1,036.91	1,037.80	823	0	853,731.66	-	853,731.66	148,452.00	3,196.32	1,005,379.97	1.581493	2.27	-0.685540	0.011719
09/01/2549	4.484286	4.721429	1,038.10	1,013.03	823	0	854,714.65	-	854,714.65	148,452.00	3,303.43	1,006,470.08				
31/03/2549	4.817143	5.122857	1,046.08	1,018.66	823	0	861,288.37	-	861,288.37	148,452.00	4,253.46	1,013,993.83	3.481105	3.05	0.428358	4.031534
08/06/2549	4.983333	5.190000	1,014.65	1,027.75	823	0	835,405.56	-	835,405.56	181,372.00	5,062.75	1,021,840.31				
30/06/2549	5.125714	5.288571	1,017.04	1,029.96	823	0	837,374.66	-	837,374.66	181,372.00	5,499.55	1,024,246.22	4.117621	3.95	0.165423	6.992767
07/07/2549	5.116667	5.278333	1,018.07	1,002.88	823	0	838,219.03	-	838,219.03	181,372.00	5,638.54	1,025,229.57				
29/09/2549	4.943333	5.000000	1,030.31	1,017.07	823	0	848,297.11	-	848,297.11	181,372.00	7,454.65	1,037,123.76	5.139157	4.00	1.139157	13.438970
30/11/2549	4.768000	4.773000	1,038.93	1,026.98	823	0	855,394.93	-	855,394.93	181,372.00	8,795.11	1,045,562.04	4.886119	4.00	0.886119	11.647765
													1.473237	1.91	-0.438168	3.895406

ตารางผนวก ง7

การคำนวณดอกเบี้ยรับและผลตอบแทนจากการลงทุนต่อในเงินฝากประจำ 12 เดือน

ของ Minimum M-Square Portfolio

วันที่	ดอกเบี้ยรับ(Coupon)		อัตราดอกเบี้ยเงิน ฝากประจำ 12 เดือน	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทนจาก การลงทุนต่อ	ดอกเบี้ยรับและ ผลตอบแทนจาก การลงทุนต่อ
	LB06DA	LB082A				
07/07/2546		15,316.00	1.75	15,316.00	0.00	15,316.00
30/09/2546				15,316.00	62.42	15,378.42
08/12/2546	11,400.00		1.50	26,716.00	113.09	26,829.09
31/12/2546				26,716.00	140.75	26,856.75
07/01/2547		11,144.00	1.75	37,860.00	149.17	38,009.17
31/03/2547				37,860.00	293.35	38,153.35
08/06/2547	17,200.00		1.75	55,060.00	413.21	55,473.21
30/06/2547				55,060.00	469.57	55,529.57
07/07/2547		7,196.00	1.75	62,256.00	487.51	62,743.51
30/09/2547				62,256.00	735.68	62,991.68
08/12/2547	22,720.00		1.75	84,976.00	937.13	85,913.13
30/12/2547				84,976.00	1,027.23	86,003.23
07/01/2548		3,976.00	2.00	88,952.00	1,059.99	90,011.99
31/03/2548				88,952.00	1,429.60	90,381.60
08/06/2548	27,240.00		2.25	116,192.00	1,732.38	117,924.38
30/06/2548				116,192.00	1,871.72	118,063.72
07/07/2548		1,540.00	2.25	117,732.00	1,914.96	119,646.96
30/09/2548				117,732.00	2,489.99	120,221.99
08/12/2548	30,720.00		3.25	148,452.00	2,955.13	151,407.13
30/12/2548				148,452.00	3,196.32	151,648.32
09/01/2549		0.00	3.75	148,452.00	3,303.43	151,755.43
31/03/2549				148,452.00	4,253.46	152,705.46
08/06/2549	32,920.00		5.05	181,372.00	5,062.75	186,434.75
30/06/2549				181,372.00	5,499.55	186,871.55
07/07/2549		0.00	4.75	181,372.00	5,638.54	187,010.54
29/09/2549				181,372.00	7,454.65	188,826.65
30/11/2549				181,372.00	8,795.11	190,167.11

ตารางผนวก 8
การจัดสรรน้ำหนักของแต่ละพันธบัตรใน Minimum M-Square Portfolio

วันที่	ระยะเวลา การลงทุน (ปี)	Duration ของ Portfolio	Minimum M-Square Portfolios		M-Square ของ Portfolios
			LB06DA	LB077A	
2/07/2546	3.42	3.42	0.350000	0.650000	0.930000
31/12/2546	2.92	2.92	0.527701	0.472299	0.618681
30/06/2547	2.42	2.42	0.693806	0.306194	0.362088
30/12/2547	1.92	1.92	0.828692	0.171308	0.182738
30/06/2548	1.42	1.42	0.933190	0.066810	0.067605
30/12/2548	0.92	0.92	1.000000	0.000000	0.009477
30/06/2549	0.42	0.44	1.000000	0.000000	0.000445
30/11/2549	0.00	0.02	1.000000	0.000000	

ตารางผนวก ง9

กระแสเงินสดหรือผลตอบแทนรวมที่คาดหวังจากการลงทุนของ Random Portfolio (1)

อัตราผลตอบแทน(Yield) 1.45%

วันที่	ราคาตลาด (บาทต่อหน่วย)		จำนวนหน่วย		มูลค่าของ Portfolios (บาท)									
	LB06DA	LB08DA	LB06DA	LB08DA	ผลตอบแทนรวม	ผลตอบแทน จากราคารวม	ดอกเบี้ยรับรวม	ผลตอบแทน ลงทุนต่อรวม	LB06DA			LB08DA		
									ผลตอบแทน จากราคา	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน ลงทุนต่อ	ผลตอบแทน จากราคา	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน ลงทุนต่อ
02/07/2546	1,226.22	1,362.67	644	154	1,000,000.00	1,000,000.00	-	-	790,000.00	-	-	210,000.00	-	-
08/12/2546	1,191.63	1,338.87	666	159	1,006,351.84	974,046.84	32,305.00	-	767,715.40	25,760.00	-	206,331.44	6,545.00	-
08/06/2547	1,160.22	1,306.02	689	164	1,013,613.63	948,750.64	64,610.00	252.99	747,481.02	51,520.00	201.05	201,269.62	13,090.00	51.94
08/12/2547	1,128.64	1,272.99	713	170	1,020,962.38	923,309.89	96,915.00	737.49	727,130.55	77,280.00	592.93	196,179.33	19,635.00	144.56
08/06/2548	1,096.82	1,239.72	739	175	1,028,369.97	897,684.69	129,220.00	1,465.29	706,632.55	103,040.00	1,157.67	191,052.14	26,180.00	307.62
08/12/2548	1,064.82	1,206.26	767	182	1,035,835.56	871,908.22	161,525.00	2,402.34	686,013.09	128,800.00	1,917.19	185,895.13	32,725.00	485.15
08/06/2549	1,032.49	1,172.46	797	188	1,043,319.48	845,875.59	193,830.00	3,613.89	665,189.63	154,560.00	2,869.36	180,685.97	39,270.00	744.53
30/11/2549	1,039.67	1,180.61	797	188	1,050,598.13	851,781.80	193,830.00	4,986.33	669,839.88	154,560.00	3,963.65	181,941.92	39,270.00	1,022.67

ตารางผนวก ง10

การแสดงผลการดำเนินงานของ Random Portfolio (1)

วันที่	อัตราผลตอบแทน (Yield) (%)		ราคาตลาด (บาทต่อหน่วย)		จำนวนหน่วย		มูลค่าของกลุ่มหลักทรัพย์ (บาท)			ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน การลงทุนต่อ รวม	มูลค่าเงินลงทุน และผลตอบแทน รวมทั้งหมด	อัตรา ผลตอบแทนที่ ได้รับจริง(Ri)	อัตราดอกเบี้ยเงิน ฝากประจำ 12 เดือนเฉลี่ย(Rf)	อัตราเฉลี่ย (Ri - Rf)	ค่าส่วน เบี่ยงเบน มาตรฐาน
	LB06DA	LB08DA	LB06DA	LB08DA	LB06DA	LB08DA	LB06DA	LB08DA	รวม							
02/07/2546	1.387916	1.610000	1,226.22	1,362.67	644	154	790,000.00	210,000.00	1,000,000.00	0.00	0.00	1,000,000.00				
30/09/2546	1.516667	2.135000	1,225.93	1,337.46	644	154	789,814.24	206,113.65	995,927.89	0.00	0.00	995,927.89	-1.641223	1.07	-2.706984	9.509335
08/12/2546	2.392000	3.188000	1,161.45	1,243.78	644	154	748,272.91	191,677.39	939,950.31	32,305.00	0.00	972,255.31				
31/12/2546	2.084000	2.776000	1,172.75	1,267.76	687	115	805,344.15	145,577.55	950,921.70	32,305.00	30.53	983,257.24	-4.953009	1.01	-5.962248	40.902509
31/03/2547	1.553333	2.341667	1,193.98	1,298.35	687	115	819,925.53	149,089.95	969,015.47	32,305.00	150.02	1,001,470.49	7.727580	1.00	6.727580	39.502257
08/06/2547	2.105714	3.365714	1,142.78	1,212.69	687	115	784,766.41	139,253.63	924,020.04	64,672.50	241.62	988,934.17				
30/06/2547	2.180000	3.271667	1,142.32	1,219.46	732	72	836,209.22	88,270.22	924,479.44	64,672.50	304.97	989,456.91	-4.725362	1.00	-5.725362	38.042496
30/09/2547	2.371667	3.290000	1,144.20	1,228.68	732	72	837,583.51	88,937.54	926,521.05	64,672.50	569.88	991,763.44	0.928044	1.00	-0.071956	0.264663
08/12/2547	2.662000	3.520000	1,103.26	1,184.25	732	72	807,617.25	85,721.49	893,338.75	97,012.50	768.57	991,119.81				
30/12/2547	2.758333	3.505000	1,103.09	1,187.35	767	39	846,615.91	46,826.19	893,442.11	97,012.50	871.41	991,326.01	-0.176790	1.00	-1.176790	2.622093
31/03/2548	2.791667	3.385000	1,110.16	1,202.34	767	39	852,038.61	47,417.47	899,456.08	97,012.50	1,301.46	997,770.04	2.603946	1.00	1.603946	1.348962
08/06/2548	3.013333	3.393333	1,072.56	1,167.14	767	39	823,178.81	46,029.27	869,208.08	129,350.00	1,622.45	1,000,180.53				
30/06/2548	2.971667	3.331667	1,075.10	1,171.69	794	15	853,951.25	17,391.12	871,342.37	129,350.00	1,779.67	1,002,472.04	1.903634	1.02	0.886601	0.212646
30/09/2548	3.820000	4.774000	1,072.93	1,135.33	794	15	852,223.98	16,851.43	869,075.41	129,350.00	2,437.12	1,000,862.54	-0.635462	1.40	-2.031114	4.317917
08/12/2548	4.596667	5.438333	1,032.96	1,083.79	794	15	820,475.60	16,086.31	836,561.91	161,747.50	2,927.09	1,001,236.50				
30/12/2548	4.477143	5.108571	1,036.91	1,096.64	810	0	839,887.78	-	839,887.78	161,747.50	3,208.89	1,004,844.17	1.605233	2.27	-0.661800	0.026483
31/03/2549	4.817143	5.260000	1,046.08	1,106.57	810	0	847,321.96	-	847,321.96	161,747.50	4,374.50	1,013,443.96	3.477225	3.05	0.424478	4.140114
08/06/2549	4.983333	5.315000	1,014.65	1,073.57	810	0	821,858.85	-	821,858.85	194,147.50	5,258.32	1,021,264.68				
30/06/2549	5.125714	5.418571	1,017.04	1,074.53	810	0	823,796.03	-	823,796.03	194,147.50	5,753.37	1,023,696.90	4.120113	3.95	0.167915	7.169622
29/09/2549	4.943333	5.007500	1,030.31	1,097.73	810	0	834,541.36	-	834,541.36	194,147.50	7,801.05	1,036,489.91	5.107583	4.00	1.107583	13.432849
30/11/2549	4.768000	4.724000	1,038.93	1,112.62	810	0	841,524.08	-	841,524.08	194,147.50	9,196.18	1,044,867.76	4.853459	4.00	0.853459	11.634655
													1.442498	1.91	-0.468907	3.649306

ตารางผนวก ง11

การคำนวณดอกเบี้ยรับและผลตอบแทนจากการลงทุนต่อในเงินฝากประจำ 12 เดือน

ของ Random Portfolio (1)

วันที่	ดอกเบี้ยรับ(Coupon)		อัตราดอกเบี้ยเงิน ฝากประจำ 12 เดือน	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทนจาก การลงทุนต่อ	ดอกเบี้ยรับและ ผลตอบแทนจาก การลงทุนต่อ
	LB06DA	LB08DA				
08/12/2546	25,760.00	6,545.00	1.50	32,305.00	0.00	32,305.00
31/12/2546				32,305.00	30.53	32,335.53
31/03/2547				32,305.00	150.02	32,455.02
08/06/2547	27,480.00	4,887.50	1.75	64,672.50	241.62	64,914.12
30/06/2547				64,672.50	304.97	64,977.47
30/09/2547				64,672.50	569.88	65,242.38
08/12/2547	29,280.00	3,060.00	1.75	97,012.50	768.57	97,781.07
30/12/2547				97,012.50	871.41	97,883.91
31/03/2548				97,012.50	1,301.46	98,313.96
08/06/2548	30,680.00	1,657.50	2.25	129,350.00	1,622.45	130,972.45
30/06/2548				129,350.00	1,779.67	131,129.67
30/09/2548				129,350.00	2,437.12	131,787.12
08/12/2548	31,760.00	637.50	3.25	161,747.50	2,927.09	164,674.59
30/12/2548				161,747.50	3,208.89	164,956.39
31/03/2549				161,747.50	4,374.50	166,122.00
08/06/2549	32,400.00	0.00	5.05	194,147.50	5,258.32	199,405.82
30/06/2549				194,147.50	5,753.37	199,900.87
29/09/2549				194,147.50	7,801.05	201,948.55
30/11/2549				194,147.50	9,196.18	203,343.68

ตารางผนวก ง12

การจัดสรรน้ำหนักของแต่ละพันธบัตรใน Random Portfolio (1)

วันที่	ระยะเวลา การลงทุน (ปี)	Duration ของ Portfolio	Random Portfolios (1)	
			LB06DA	LB08DA
2/07/2546	3.42	3.42	0.790000	0.210000
31/12/2546	2.92	2.92	0.846909	0.153091
30/06/2547	2.42	2.42	0.904519	0.095481
30/12/2547	1.92	1.92	0.947589	0.052411
30/06/2548	1.42	1.42	0.980041	0.019959
30/12/2548	0.92	0.92	1.000000	0.000000
30/06/2549	0.42	0.44	1.000000	0.000000
30/11/2549	0.00	0.02	1.000000	0.000000

ตารางผนวก 13

กระแสเงินสดหรือผลตอบแทนรวมที่คาดหวังจากการลงทุนของ Random Portfolio (2)

อัตราผลตอบแทน(Yield) 1.45%

วันที่	ราคาตลาด (บาทต่อหน่วย)		จำนวนหน่วย		มูลค่าของกลุ่มหลักทรัพย์ (บาท)									
	LB06DA	LB143A	LB06DA	LB143A	ผลตอบแทนรวม	ผลตอบแทน จากราคารวม	ดอกเบี้ยรับรวม	ผลตอบแทน ลงทุนต่อรวม	LB06DA			LB143A		
									ผลตอบแทน จากราคา	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน ลงทุนต่อ	ผลตอบแทน จากราคา	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน ลงทุนต่อ
02/07/2546	1,230.25	1,587.01	756	44	1,000,000.00	1,000,000.00	-	-	930,000.00	-	-	70,000.00	-	-
05/09/2546	1,227.03	1,660.19	756	45	1,002,610.80	1,000,795.80	1,815.00	-	927,567.83	-	-	73,227.97	1,815.00	-
08/12/2546	1,191.63	1,666.38	781	45	1,006,368.36	974,306.59	32,055.00	6.77	900,805.65	30,240.00	-	73,500.94	1,815.00	6.77
08/03/2547	1,195.88	1,630.97	781	46	1,009,946.97	975,959.74	33,870.00	117.23	904,020.44	30,240.00	107.92	71,939.30	3,630.00	9.31
08/06/2547	1,160.22	1,636.92	808	46	1,013,600.78	949,265.22	64,110.00	225.56	877,063.47	60,480.00	202.98	72,201.75	3,630.00	22.59
06/09/2547	1,164.37	1,601.55	808	48	1,017,205.50	950,834.81	65,925.00	445.69	880,193.52	60,480.00	419.54	70,641.29	5,445.00	26.14
08/12/2547	1,128.64	1,607.45	837	48	1,020,929.06	924,086.88	96,165.00	677.18	853,185.07	90,720.00	630.86	70,901.81	5,445.00	46.32
07/03/2548	1,132.67	1,571.84	837	49	1,024,587.57	925,561.03	97,980.00	1,046.54	856,229.91	90,720.00	956.87	69,331.12	7,260.00	89.67
08/06/2548	1,096.82	1,577.64	867	49	1,028,352.79	898,720.36	128,220.00	1,412.43	829,133.55	120,960.00	1,295.65	69,586.81	7,260.00	116.78
05/09/2548	1,100.69	1,542.05	867	50	1,031,995.31	900,076.60	130,035.00	1,883.71	832,059.63	120,960.00	1,727.10	68,016.97	9,075.00	156.61
08/12/2548	1,064.82	1,547.80	900	50	1,035,844.31	873,210.04	160,275.00	2,359.27	804,939.53	151,200.00	2,168.25	68,270.51	9,075.00	191.02
06/03/2549	1,068.53	1,511.86	900	51	1,039,450.25	874,433.49	162,090.00	2,926.77	807,748.25	151,200.00	2,703.40	66,685.24	10,890.00	223.36
08/06/2549	1,032.49	1,517.49	935	51	1,043,307.60	847,439.95	192,330.00	3,537.65	780,506.13	181,440.00	3,272.86	66,933.82	10,890.00	264.79
05/09/2549	1,036.14	1,481.68	935	53	1,046,975.11	848,615.06	194,145.00	4,215.06	783,260.61	181,440.00	3,924.72	65,354.45	12,705.00	290.33
30/11/2549	1,039.67	1,486.74	935	53	1,050,598.13	851,561.68	194,145.00	4,891.45	785,984.37	181,440.00	4,556.80	65,577.30	12,705.00	334.65

ตารางผนวก ง14

การแสดงผลการดำเนินงานของ Random Portfolio (2)

วันที่	อัตราผลตอบแทน (Yield) (%)		ราคาตลาด (บาทต่อหน่วย)		จำนวนหน่วย		มูลค่าของกลุ่มหลักทรัพย์ (บาท)			ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน การลงทุนต่อ รวม	มูลค่าเงินลงทุนและ ผลตอบแทนรวม ทั้งหมด	อัตรา ผลตอบแทนที่ ได้รับจริง(Ri)	อัตราดอกเบี้ยเงิน ฝากประจำ 12 เดือนเฉลี่ย(Rf)	อัตราเฉลี่ย (Ri - Rf)	ค่าส่วน เบี่ยงเบน มาตรฐาน
	LB06DA	LB143A	LB06DA	LB143A	LB06DA	LB143A	LB06DA	LB143A	รวม							
02/07/2546	1.281343	2.300000	1,230.25	1,587.01	756	44	930,000.00	70,000.00	1,000,000.00	0.00	0.00	1,000,000.00				
05/09/2546	1.583333	3.418333	1,222.30	1,423.46	756	44	923,990.40	62,786.29	986,776.69	1,815.00	0.00	988,591.69				
30/09/2546	1.516667	3.493333	1,225.93	1,419.26	756	44	926,735.53	62,601.10	989,336.63	1,815.00	1.86	991,153.49	-3.539557	1.07	-4.605318	23.682872
08/12/2546	2.392000	5.066000	1,161.45	1,273.38	756	44	877,992.64	56,166.59	934,159.24	32,055.00	7.01	966,221.25				
31/12/2546	2.084000	4.998000	1,172.75	1,283.59	763	37	895,172.74	47,974.11	943,146.85	32,055.00	37.31	975,239.16	-6.220025	1.01	-7.229264	56.956804
08/03/2547	1.681429	4.494286	1,189.03	1,300.09	763	37	907,600.13	48,590.80	956,190.93	33,581.25	125.57	989,897.75				
31/03/2547	1.553333	4.038333	1,193.98	1,347.31	763	37	911,380.54	50,355.40	961,735.94	33,581.25	157.55	995,474.74	8.685602	1.00	7.685602	54.149787
08/06/2547	2.105714	5.072857	1,142.78	1,262.90	763	37	872,299.74	47,200.56	919,500.31	64,101.25	253.50	983,855.05				
30/06/2547	2.180000	5.120000	1,142.32	1,262.63	779	23	890,048.73	29,087.92	919,136.65	64,101.25	316.28	983,554.18	-4.717163	1.00	-5.717163	36.531280
06/09/2547	2.371429	4.710000	1,142.43	1,268.88	779	23	890,134.85	29,231.77	919,366.62	65,050.00	510.26	984,926.88				
30/09/2547	2.371667	4.573333	1,144.20	1,284.80	779	23	891,511.51	29,598.56	921,110.08	65,050.00	580.18	986,740.25	1.291364	1.00	0.291364	0.001266
08/12/2547	2.662000	4.719000	1,103.26	1,283.24	779	23	859,615.87	29,562.77	889,178.64	96,210.00	781.17	986,169.82				
30/12/2547	2.758333	4.743333	1,103.09	1,284.78	792	12	873,746.80	15,338.68	889,085.29	96,210.00	883.16	986,178.46	-0.228168	1.00	-1.228168	2.418386
07/03/2548	2.887143	4.595714	1,106.42	1,266.96	792	12	876,380.89	15,125.96	891,506.85	96,705.00	1,198.40	989,410.25				
31/03/2548	2.791667	4.316667	1,110.16	1,294.49	792	12	879,343.27	15,454.52	894,797.79	96,705.00	1,310.60	992,813.39	2.695989	1.00	1.695989	1.874273
08/06/2548	3.013333	3.973333	1,072.56	1,334.34	792	12	849,558.62	15,930.29	865,488.91	128,385.00	1,631.70	995,505.61				
30/06/2548	2.971667	3.891667	1,075.10	1,344.56	802	4	861,988.78	5,639.58	867,628.36	128,385.00	1,787.44	997,800.80	2.030217	1.02	1.013184	0.494587
05/09/2548	3.561667	4.740000	1,073.42	1,243.48	802	4	860,639.49	5,215.59	865,855.08	128,550.00	2,261.72	996,666.80				
30/09/2548	3.820000	5.184000	1,072.93	1,213.13	802	4	860,245.25	5,088.31	865,333.56	128,550.00	2,440.07	996,323.64	-0.586052	1.40	-1.981704	3.659570

ตารางผนวก ง14 (ต่อ)

การแสดงผลการดำเนินงานของ Random Portfolio (2)

วันที่	อัตราผลตอบแทน (Yield) (%)		ราคาตลาด (บาทต่อหน่วย)		จำนวนหน่วย		มูลค่าของกลุ่มหลักทรัพย์ (บาท)			ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทน การลงทุนต่อ รวม	มูลค่าเงินลงทุนและ ผลตอบแทนรวม ทั้งหมด	อัตรา ผลตอบแทนที่ ได้รับจริง(Ri)	อัตราดอกเบี้ยเงิน ฝากประจำ 12 เดือนเฉลี่ย(Rf)	อัตราเฉลี่ย (Ri - Rf)	ค่าส่วน เบี่ยงเบน มาตรฐาน
	LB06DA	LB143A	LB06DA	LB143A	LB06DA	LB143A	LB06DA	LB143A	รวม							
08/12/2548	4.596667	5.885000	1,032.96	1,174.10	802	4	828,198.05	4,924.59	833,122.63	160,630.00	2,929.38	996,682.01				
30/12/2548	4.477143	5.367143	1,036.91	1,215.25	807	0	836,459.88	-	836,459.88	160,630.00	3,207.22	1,000,297.09	1.609261	2.27	-0.657772	0.079701
06/03/2549	4.501667	5.081667	1,045.06	1,206.07	807	0	843,034.40	-	843,034.40	160,630.00	4,040.85	1,007,705.25				
31/03/2549	4.817143	5.487143	1,046.08	1,181.26	807	0	843,863.72	-	843,863.72	160,630.00	4,359.49	1,008,853.21	3.475264	3.05	0.422517	4.615261
08/06/2549	4.983333	5.443333	1,014.65	1,196.43	807	0	818,504.54	-	818,504.54	192,910.00	5,238.95	1,016,653.48				
30/06/2549	5.125714	5.604286	1,017.04	1,189.33	807	0	820,433.80	-	820,433.80	192,910.00	5,727.78	1,019,071.58	4.124985	3.95	0.172787	7.829010
05/09/2549	4.915000	5.146667	1,027.08	1,191.33	807	0	828,529.89	-	828,529.89	192,910.00	7,216.50	1,028,656.39				
29/09/2549	4.943333	5.103333	1,030.31	1,198.27	807	0	831,135.28	-	831,135.28	192,910.00	7,754.83	1,031,800.11	5.104849	4.00	1.104849	14.272535
30/11/2549	4.768000	4.684000	1,038.93	1,237.00	807	0	838,089.50	-	838,089.50	192,910.00	9,135.91	1,040,135.41	4.850708	4.00	0.850708	12.416884
													1.326948	1.91	-0.584456	4.104240

ตารางผนวก ง15

การคำนวณดอกเบี้ยรับและผลตอบแทนจากการลงทุนต่อในเงินฝากประจำ 12 เดือน

ของ Random Portfolio (2)

วันที่	ดอกเบี้ยรับ(Coupon)		อัตราดอกเบี้ยเงิน ฝากประจำ 12 เดือน	ดอกเบี้ยรับ	ผลตอบแทนจาก การลงทุนต่อ	ดอกเบี้ยรับและ ผลตอบแทนจาก การลงทุนต่อ
	LB06DA	LB082A				
05/09/2546		1,815.00	1.50	1,815.00	0.00	1,815.00
30/09/2546				1,815.00	1.86	1,816.86
08/12/2546	30,240.00		1.50	32,055.00	7.01	32,062.01
31/12/2546				32,055.00	37.31	32,092.31
08/03/2547		1,526.25	1.75	33,581.25	125.57	33,706.82
31/03/2547				33,581.25	157.55	33,738.80
08/06/2547	30,520.00		1.75	64,101.25	253.50	64,354.75
30/06/2547				64,101.25	316.28	64,417.53
06/09/2547		948.75	1.75	65,050.00	510.26	65,560.26
30/09/2547				65,050.00	580.18	65,630.18
08/12/2547	31,160.00		1.75	96,210.00	781.17	96,991.17
30/12/2547				96,210.00	883.16	97,093.16
07/03/2548		495.00	2.00	96,705.00	1,198.40	97,903.40
31/03/2548				96,705.00	1,310.60	98,015.60
08/06/2548	31,680.00		2.25	128,385.00	1,631.70	130,016.70
30/06/2548				128,385.00	1,787.44	130,172.44
05/09/2548		165.00	2.30	128,550.00	2,261.72	130,811.72
30/09/2548				128,550.00	2,440.07	130,990.07
08/12/2548	32,080.00		3.25	160,630.00	2,929.38	163,559.38
30/12/2548				160,630.00	3,207.22	163,837.22
06/03/2549		0.00	4.00	160,630.00	4,040.85	164,670.85
31/03/2549				160,630.00	4,359.49	164,989.49
08/06/2549	32,280.00		5.05	192,910.00	5,238.95	198,148.95
30/06/2549				192,910.00	5,727.78	198,637.78
05/09/2549		0.00	4.75	192,910.00	7,216.50	200,126.50
29/09/2549				192,910.00	7,754.83	200,664.83
30/11/2549				192,910.00	9,135.91	202,045.91

ตารางผนวก ง16

การจัดสรรน้ำหนักของแต่ละพันธบัตรใน Random Portfolio (2)

วันที่	ระยะเวลา การลงทุน (ปี)	Duration ของ Portfolio	Random Portfolios (2)	
			LB06DA	LB143A
2/07/2546	3.42	3.42	0.930000	0.070000
31/12/2546	2.92	2.92	0.949134	0.050866
30/06/2547	2.42	2.42	0.968353	0.031647
30/12/2547	1.92	1.92	0.982748	0.017252
30/06/2548	1.42	1.42	0.993500	0.006500
30/12/2548	0.92	0.92	1.000000	0.000000
30/06/2549	0.42	0.44	1.000000	0.000000
30/11/2549	0.00	0.02	1.000000	0.000000