

ภาคผนวก ก
ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา

ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษาสมการถดถอยเชิงพหุ (Multiple Regression)
วิธีกำลังสองน้อยที่สุด (Ordinary Least Squares-OLS)

ตารางผนวกที่ ก1 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษาแบบลำดับของชุดข้อมูล (Level Data) ระหว่างเดือนมกราคม
ปี พ.ศ. 2545 ถึงเดือนมิถุนายน ปี พ.ศ. 2548

เวลา		NAV1	NAV2	NAV3	T_NAV	INT	CPI	MPI	TbRate	CopRate
พ.ศ.	ม.ค.	9.4092	12.7100	9.8002	11.4915	2.75	99.10	102.40	2.222564	2.442059
2545	ก.พ.	9.4161	12.7058	9.8002	11.4905	2.50	99.90	104.00	2.316320	2.365347
	มี.ค.	9.4303	12.6882	9.8122	11.4849	2.50	99.50	118.80	2.343834	2.285895
	เม.ย.	9.4551	12.7263	9.8352	11.5175	2.50	100.00	103.50	2.292357	2.360602
	พ.ค.	9.4465	12.7724	9.8830	11.5517	2.50	100.10	113.10	2.239380	2.320773
	มิ.ย.	9.4735	12.8223	9.9190	11.5943	2.50	99.90	110.80	2.199174	2.248867
	ก.ค.	9.5001	12.8635	9.9331	11.6277	2.50	99.80	108.10	2.134128	2.313236
	ส.ค.	9.5285	12.9110	10.0139	11.6765	2.50	99.90	113.70	1.978163	2.225094
	ก.ย.	9.5660	12.9984	10.1012	11.7528	2.50	100.30	113.20	2.036014	2.181481
	ต.ค.	9.5938	13.0443	10.1477	11.7948	2.00	100.90	117.50	1.985360	2.133270
	พ.ย.	9.6179	13.0500	10.2273	11.8169	2.00	100.40	120.60	1.799282	2.053818
	ธ.ค.	9.6442	13.0998	10.2609	11.8588	2.00	100.50	115.40	1.799267	2.442059
	พ.ศ.	ม.ค.	9.6822	13.1569	10.2552	11.9011	2.00	101.30	122.80	1.622699
2546	ก.พ.	9.6876	13.1756	10.2988	11.9211	2.00	101.20	118.50	1.524521	1.894611
	มี.ค.	9.7087	13.2001	10.3310	11.9461	1.75	101.20	135.70	1.655539	2.116504
	เม.ย.	9.7213	13.2073	10.3468	11.9559	1.75	101.60	123.10	1.665883	2.179630
	พ.ค.	9.7081	13.2627	10.3850	11.9932	1.75	102.00	126.20	1.614670	2.060975
	มิ.ย.	9.7337	13.3285	10.4234	12.0455	1.25	101.60	124.80	1.338680	2.007027
	ก.ค.	9.7575	13.3394	10.4042	12.0542	1.00	101.60	123.60	1.237141	2.023414
	ส.ค.	9.7539	13.3230	10.3975	12.0423	1.00	102.10	121.30	1.266601	2.094828
	ก.ย.	9.7616	13.2962	10.3745	12.0238	1.00	102.00	128.30	1.229725	2.088813
	ต.ค.	9.7599	13.2394	10.3232	11.9801	1.00	102.10	134.20	1.416342	2.031377
	พ.ย.	9.7376	13.1346	10.1507	11.8824	1.00	102.20	129.00	1.519170	1.973965
	ธ.ค.	9.7593	13.1852	10.1647	11.9205	1.00	102.30	140.20	1.370220	1.943781

ตารางผนวกที่ ก1 (ต่อ)

เวลา		NAV1	NAV2	NAV3	T_NAV	INT	CPI	MPI	TbRate	CopRate
พ.ศ.	ม.ค.	9.7798	13.2228	10.1736	11.9495	1.00	102.60	138.80	1.336319	1.966647
2547	ก.พ.	9.7794	13.2295	10.2128	11.9601	1.00	103.40	140.60	1.321833	1.883866
	มี.ค.	9.7885	13.2036	10.2386	11.9505	1.00	103.60	147.50	1.250628	1.954737
	เม.ย.	9.7809	13.1623	10.2310	11.9223	1.00	104.10	134.50	1.424529	1.943880
	พ.ค.	9.7641	13.1304	10.1685	11.8887	1.00	104.70	137.10	1.497609	1.925661
	มิ.ย.	9.7652	13.1625	10.1625	11.9076	1.00	104.80	137.60	1.580778	1.868205
	ก.ค.	9.7699	13.1776	10.1576	11.9170	1.00	105.30	140.00	1.832025	1.798431
	ส.ค.	9.7765	13.1880	10.1578	11.9248	1.00	105.70	134.00	1.875387	1.715778
	ก.ย.	9.7891	13.2279	10.1795	11.9557	1.00	105.70	146.00	1.952788	1.768189
	ต.ค.	9.8007	13.2329	10.1923	11.9635	1.00	105.70	146.30	2.070877	1.739480
	พ.ย.	9.7985	13.1814	10.1959	11.9978	1.00	105.30	144.30	2.253906	1.824470
	ธ.ค.	9.8110	13.2087	10.3702	12.1383	1.00	105.30	149.60	2.292655	1.770454
พ.ศ.	ม.ค.	9.8216	13.2302	10.3790	12.1559	1.00	105.40	144.70	2.050638	1.761985
2548	ก.พ.	9.8231	13.2552	10.3940	12.1746	1.00	106.00	138.80	2.064662	1.685550
	มี.ค.	9.8410	13.2674	10.4253	12.1902	1.00	106.90	159.90	2.085173	1.767350
	เม.ย.	9.8569	13.2910	10.4513	12.2123	1.00	107.80	142.70	2.184976	1.809427
	พ.ค.	9.8553	13.2969	10.4695	12.2180	1.00	108.40	148.40	2.315911	1.726440
	มิ.ย.	9.8666	13.3177	10.4929	12.2369	1.00	108.70	150.50	2.253722	1.803350

ตารางผนวกที่ ก2 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษาแบบผลต่างของชุดข้อมูล (Difference Level Data) ระหว่าง
เดือนมกราคม ปี พ.ศ. 2545 ถึงเดือนมิถุนายน ปี พ.ศ. 2548

เวลา		NAV1	NAV2	NAV3	T_NAV	INT	CPI	MPI	TbRate	CopRate
พ.ศ.	ม.ค.	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.00	0.00	0.00	0.000000	0.000000
2545	ก.พ.	0.0069	-0.0042	0.0000	-0.0011	-0.25	0.80	1.60	0.093756	-0.076712
	มี.ค.	0.0142	-0.0176	0.0120	-0.0056	0.00	-0.40	14.80	0.027513	-0.079452
	เม.ย.	0.0247	0.0381	0.0230	0.0326	0.00	0.50	-15.30	-0.051476	0.074707
	พ.ค.	-0.0085	0.0460	0.0478	0.0342	0.00	0.10	9.60	-0.052977	-0.039828
	มิ.ย.	0.0269	0.0500	0.0360	0.0425	0.00	-0.20	-2.30	-0.040206	-0.071906
	ก.ค.	0.0266	0.0412	0.0141	0.0335	0.00	-0.10	-2.70	-0.065046	0.064369
	ส.ค.	0.0284	0.0475	0.0808	0.0488	0.00	0.10	5.60	-0.155965	-0.088142
	ก.ย.	0.0375	0.0873	0.0874	0.0763	0.00	0.40	-0.50	0.057851	-0.043613
	ต.ค.	0.0278	0.0460	0.0465	0.0420	-0.50	0.60	4.30	-0.050654	-0.048211
	พ.ย.	0.0241	0.0057	0.0796	0.0221	0.00	-0.50	3.10	-0.186077	-0.079452
	ธ.ค.	0.0264	0.0498	0.0336	0.0419	0.00	0.10	-5.20	-0.000016	0.388241
พ.ศ.	ม.ค.	0.0380	0.0570	-0.0058	0.0423	0.00	0.80	7.40	-0.176568	-0.498278
2546	ก.พ.	0.0054	0.0188	0.0436	0.0199	0.00	-0.10	-4.30	-0.098178	-0.049169
	มี.ค.	0.0211	0.0245	0.0322	0.0250	-0.25	0.00	17.20	0.131018	0.221892
	เม.ย.	0.0125	0.0072	0.0158	0.0098	0.00	0.40	-12.60	0.010345	0.063126
	พ.ค.	-0.0132	0.0555	0.0383	0.0373	0.00	0.40	3.10	-0.051214	-0.118654
	มิ.ย.	0.0256	0.0658	0.0383	0.0523	-0.50	-0.40	-1.40	-0.275990	-0.053948
	ก.ค.	0.0238	0.0108	-0.0191	0.0087	-0.25	0.00	-1.20	-0.101540	0.016387
	ส.ค.	-0.0035	-0.0164	-0.0067	-0.0119	0.00	0.50	-2.30	0.029461	0.071414
	ก.ย.	0.0076	-0.0268	-0.0231	-0.0185	0.00	-0.10	7.00	-0.036876	-0.006015
	ต.ค.	-0.0017	-0.0568	-0.0513	-0.0436	0.00	0.10	5.90	0.186617	-0.057436
	พ.ย.	-0.0223	-0.1048	-0.1725	-0.0977	0.00	0.10	-5.20	0.102828	-0.057413
	ธ.ค.	0.0217	0.0506	0.0141	0.0381	0.00	0.10	11.20	-0.148951	-0.030184

ตารางผนวกที่ ก2 (ต่อ)

เวลา		NAV1	NAV2	NAV3	T_NAV	INT	CPI	MPI	TbRate	CopRate
พ.ศ. 2547	ม.ค.	0.0205	0.0376	0.0089	0.0290	0.00	0.30	-1.40	-0.033901	0.022866
	ก.พ.	-0.0004	0.0067	0.0393	0.0105	0.00	0.80	1.80	-0.014486	-0.082781
	มี.ค.	0.0091	-0.0259	0.0258	-0.0095	0.00	0.20	6.90	-0.071205	0.070871
	เม.ย.	-0.0076	-0.0413	-0.0077	-0.0282	0.00	0.50	-13.00	0.173901	-0.010857
	พ.ค.	-0.0168	-0.0320	-0.0625	-0.0337	0.00	0.60	2.60	0.073080	-0.018220
	มิ.ย.	0.0012	0.0322	-0.0060	0.0189	0.00	0.10	0.50	0.083169	-0.057456
	ก.ค.	0.0047	0.0151	-0.0049	0.0094	0.00	0.50	2.40	0.251247	-0.069774
	ส.ค.	0.0065	0.0104	0.0002	0.0078	0.00	0.40	-6.00	0.043362	-0.082653
	ก.ย.	0.0127	0.0399	0.0217	0.0308	0.00	0.00	12.00	0.077401	0.052411
	ต.ค.	0.0116	0.0050	0.0129	0.0078	0.00	0.00	0.30	0.118089	-0.028709
	พ.ย.	-0.0022	-0.0515	0.0035	0.0344	0.00	-0.40	-2.00	0.183029	0.084990
	ธ.ค.	0.0125	0.0273	0.1743	0.1404	0.00	0.00	5.30	0.038749	-0.054016
พ.ศ. 2548	ม.ค.	0.0106	0.0215	0.0088	0.0177	0.00	0.10	-4.90	-0.242017	-0.008469
	ก.พ.	0.0014	0.0250	0.0150	0.0187	0.00	0.60	-5.90	0.014024	-0.076435
	มี.ค.	0.0180	0.0121	0.0313	0.0156	0.00	0.90	21.10	0.020511	0.081799
	เม.ย.	0.0159	0.0236	0.0259	0.0222	0.00	0.90	-17.20	0.099802	0.042078
	พ.ค.	-0.0015	0.0059	0.0183	0.0056	0.00	0.60	5.70	0.130936	-0.082987
	มิ.ย.	0.0112	0.0208	0.0234	0.0190	0.00	0.30	2.10	-0.062189	0.076910

ตารางผนวกที่ ก3 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษาแบบอัตราการเปลี่ยนแปลงของชุดข้อมูล (Changing Rate Level Data) ระหว่างเดือนมกราคม ปี พ.ศ. 2545 ถึงเดือนมิถุนายน ปี พ.ศ. 2548

เวลา		NAV1	NAV2	NAV3	T_NAV	INT	CPI	MPI	TbRate	CopRate
พ.ศ.	ม.ค.	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.00	0.00	0.00	0.000000	0.000000
2545	ก.พ.	0.0733	-0.0334	0.0000	-0.0092	-9.09	0.81	2.36	4.218361	-3.141284
	มี.ค.	0.1509	-0.1383	0.1227	-0.0485	0.00	-0.40	3.12	1.187806	-3.359000
	เม.ย.	0.2620	0.3006	0.2346	0.2841	0.00	0.50	-1.17	-2.196240	3.268160
	พ.ค.	-0.0900	0.3616	0.4855	0.2969	0.00	0.10	4.83	-2.311045	-1.687214
	มิ.ย.	0.2850	0.3913	0.3647	0.3682	0.00	-0.20	-1.59	-1.795408	-3.098377
	ก.ค.	0.2811	0.3214	0.1420	0.2885	0.00	-0.10	0.26	-2.957747	2.862286
	ส.ค.	0.2995	0.3692	0.8130	0.4197	0.00	0.10	5.17	-7.308129	-3.810320
	ก.ย.	0.3933	0.6765	0.8723	0.6531	0.00	0.40	-2.93	2.924464	-1.960052
	ต.ค.	0.2901	0.3535	0.4599	0.3573	-20.00	0.60	2.01	-2.487917	-2.210012
	พ.ย.	0.2512	0.0437	0.7848	0.1874	0.00	-0.50	4.00	-9.372467	-3.724423
	ธ.ค.	0.2741	0.3818	0.3289	0.3547	0.00	0.10	-4.44	-0.000861	18.903362
พ.ศ.	ม.ค.	0.3937	0.4352	-0.0561	0.3568	0.00	0.80	6.69	-9.813321	-20.404024
2546	ก.พ.	0.0560	0.1428	0.4249	0.1676	0.00	-0.10	-1.53	-6.050280	-2.529575
	มี.ค.	0.2179	0.1856	0.3127	0.2098	-12.50	0.00	2.71	8.594010	11.711753
	เม.ย.	0.1292	0.0544	0.1531	0.0821	0.00	0.40	2.63	0.624852	2.982572
	พ.ค.	-0.1360	0.4199	0.3699	0.3123	0.00	0.39	-1.34	-3.074265	-5.443789
	มิ.ย.	0.2638	0.4961	0.3692	0.4360	-28.57	-0.39	-0.32	-17.092640	-2.617596
	ก.ค.	0.2442	0.0813	-0.1837	0.0723	-20.00	0.00	1.37	-7.585046	0.816466
	ส.ค.	-0.0361	-0.1228	-0.0645	-0.0988	0.00	0.49	-1.44	2.381338	3.529382
	ก.ย.	0.0781	-0.2012	-0.2217	-0.1539	0.00	-0.10	2.34	-2.911388	-0.287136
	ต.ค.	-0.0170	-0.4269	-0.4946	-0.3627	0.00	0.10	3.05	15.175476	-2.749681
	พ.ย.	-0.2285	-0.7914	-1.6710	-0.8158	0.00	0.10	-2.41	7.260123	-2.826299
	ธ.ค.	0.2228	0.3852	0.1385	0.3205	0.00	0.10	8.31	-9.804728	-1.529095

ตารางผนวกที่ ก3 (ต่อ)

เวลา		NAV1	NAV2	NAV3	T_NAV	INT	CPI	MPI	TbRate	CopRate
พ.ศ.	ม.ค.	0.2102	0.2852	0.0872	0.2434	0.00	0.29	-1.09	-2.474117	1.176383
2547	ก.พ.	-0.0040	0.0506	0.3860	0.0883	0.00	0.78	4.57	-1.084035	-4.209245
	มี.ค.	0.0928	-0.1958	0.2523	-0.0796	0.00	0.19	-6.47	-5.386852	3.761987
	เม.ย.	-0.0777	-0.3127	-0.0748	-0.2360	0.00	0.48	2.66	13.905126	-0.555410
	พ.ค.	-0.1717	-0.2430	-0.6105	-0.2825	0.00	0.58	-1.25	5.130129	-0.937275
	มิ.ย.	0.0118	0.2449	-0.0586	0.1591	0.00	0.10	1.23	5.553430	-2.983678
	ก.ค.	0.0481	0.1146	-0.0485	0.0793	0.00	0.48	3.74	15.893907	-3.734815
	ส.ค.	0.0669	0.0789	0.0019	0.0658	0.00	0.38	-3.36	2.366907	-4.595850
	ก.ย.	0.1297	0.3028	0.2133	0.2586	0.00	0.00	4.78	4.127174	3.054650
	ต.ค.	0.1183	0.0379	0.1262	0.0650	0.00	0.00	-1.11	6.047218	-1.623628
	พ.ย.	-0.0226	-0.3892	0.0345	0.2874	0.00	-0.38	0.30	8.838219	4.885931
	ธ.ค.	0.1274	0.2069	1.7096	1.1705	0.00	0.00	2.99	1.719193	-2.960630
พ.ศ.	ม.ค.	0.1084	0.1627	0.0848	0.1456	0.00	0.09	-3.53	-10.556183	-0.478363
2548	ก.พ.	0.0147	0.1893	0.1450	0.1537	0.00	0.57	-0.35	0.683885	-4.337977
	มี.ค.	0.1828	0.0915	0.3012	0.1278	0.00	0.85	2.36	0.993439	4.852967
	เม.ย.	0.1611	0.1780	0.2489	0.1817	0.00	0.84	0.20	4.786285	2.380842
	พ.ค.	-0.0155	0.0444	0.1747	0.0460	0.00	0.56	1.12	5.992539	-4.586368
	มิ.ย.	0.1141	0.1566	0.2237	0.1554	0.00	0.28	2.45	-2.685293	4.454831