

ภาคผนวก ค
ข้อมูลที่ใช้ในการพยากรณ์

ข้อมูลที่ใช้ในการพยากรณ์

1. สมการที่ใช้ในการพยากรณ์มูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยของกองทุนรวมตราสารหนี้อายุไม่เกิน 1 ปี ระหว่างเดือนกรกฎาคม ปี พ.ศ. 2548 ถึงเดือนมิถุนายน ปี พ.ศ. 2549

$$\text{สมการ: NAV1} = 10.104100 - 0.045759 (\text{TbRate})$$

2. สมการที่ใช้ในการพยากรณ์มูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยของกองทุนรวมตราสารหนี้อายุ 1-2 ปี ระหว่างเดือนกรกฎาคม ปี พ.ศ. 2548 ถึงเดือนมิถุนายน ปี พ.ศ. 2549

$$\text{สมการ: NAV2} = 11.202860 + 0.022537 (\text{CPI}) - 0.152803 (\text{TbRate})$$

3. สมการที่ใช้ในการพยากรณ์มูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยของผลรวมของกองทุนรวมตราสารหนี้อายุไม่เกิน 3 ปี ระหว่างเดือนกรกฎาคม ปี พ.ศ. 2548 ถึงเดือนมิถุนายน ปี พ.ศ. 2549

$$\text{สมการ: T_NAV} = 13.120520 - 0.088021 (\text{TbRate})$$

ตารางผนวกที่ ค1 ข้อมูลอัตราผลตอบแทนเฉลี่ยของพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1-3 ปี (TbRate) จากการพยากรณ์ โดยวิธี Smoothing Techniques แบบ Five

Moving Average

(RMSE = 0.212530)

เวลา %	ก.ค. 48	ส.ค. 48	ก.ย. 48	ต.ค. 48	พ.ย. 48	ธ.ค. 48	ม.ค. 49	ก.พ. 49	มี.ค. 49	เม.ย. 49	พ.ค. 49	มิ.ย. 49
0	2.180889	2.204134	2.227926	2.236516	2.220637	2.214021	2.220647	2.223950	2.223154	2.220482	2.220451	2.221737
+1	2.190889	2.214134	2.237926	2.246516	2.230637	2.224021	2.230647	2.233950	2.233154	2.230482	2.230451	2.231737
+2	2.200889	2.224134	2.247926	2.256516	2.240637	2.234021	2.240647	2.243950	2.243154	2.240482	2.240451	2.241737
+3	2.210889	2.234134	2.257926	2.266516	2.250637	2.244021	2.250647	2.253950	2.253154	2.250482	2.250451	2.251737
+4	2.220889	2.244134	2.267926	2.276516	2.260637	2.254021	2.260647	2.263950	2.263154	2.260482	2.260451	2.261737
+5	2.230889	2.254134	2.277926	2.286516	2.270637	2.264021	2.270647	2.273950	2.273154	2.270482	2.270451	2.271737
+6	2.240889	2.264134	2.287926	2.296516	2.280637	2.274021	2.280647	2.283950	2.283154	2.280482	2.280451	2.281737
+7	2.250889	2.274134	2.297926	2.306516	2.290637	2.284021	2.290647	2.293950	2.293154	2.290482	2.290451	2.291737
+8	2.260889	2.284134	2.307926	2.316516	2.300637	2.294021	2.300647	2.303950	2.303154	2.300482	2.300451	2.301737
+9	2.270889	2.294134	2.317926	2.326516	2.310637	2.304021	2.310647	2.313950	2.313154	2.310482	2.310451	2.311737
+10	2.280889	2.304134	2.327926	2.336516	2.320637	2.314021	2.320647	2.323950	2.323154	2.320482	2.320451	2.321737
-1	2.170889	2.194134	2.217926	2.226516	2.210637	2.204021	2.210647	2.213950	2.213154	2.210482	2.210451	2.211737
-2	2.160889	2.184134	2.207926	2.216516	2.200637	2.194021	2.200647	2.203950	2.203154	2.200482	2.200451	2.201737
-3	2.150889	2.174134	2.197926	2.206516	2.190637	2.184021	2.190647	2.193950	2.193154	2.190482	2.190451	2.191737
-4	2.140889	2.164134	2.187926	2.196516	2.180637	2.174021	2.180647	2.183950	2.183154	2.180482	2.180451	2.181737
-5	2.130889	2.154134	2.177926	2.186516	2.170637	2.164021	2.170647	2.173950	2.173154	2.170482	2.170451	2.171737

ตารางผนวกที่ ค1 (ต่อ)

เวลา %	ก.ค. 48	ส.ค. 48	ก.ย. 48	ต.ค. 48	พ.ย. 48	ธ.ค. 48	ม.ค. 49	ก.พ. 49	มี.ค. 49	เม.ย. 49	พ.ค. 49	มิ.ย. 49
-5	2.130889	2.154134	2.177926	2.186516	2.170637	2.164021	2.170647	2.173950	2.173154	2.170482	2.170451	2.171737
-6	2.120889	2.144134	2.167926	2.176516	2.160637	2.154021	2.160647	2.163950	2.163154	2.160482	2.160451	2.161737
-7	2.110889	2.134134	2.157926	2.166516	2.150637	2.144021	2.150647	2.153950	2.153154	2.150482	2.150451	2.151737
-8	2.100889	2.124134	2.147926	2.156516	2.140637	2.134021	2.140647	2.143950	2.143154	2.140482	2.140451	2.141737
-9	2.090889	2.114134	2.137926	2.146516	2.130637	2.124021	2.130647	2.133950	2.133154	2.130482	2.130451	2.131737
-10	2.080889	2.104134	2.127926	2.136516	2.120637	2.114021	2.120647	2.123950	2.123154	2.120482	2.120451	2.121737

ตารางผนวกที่ ค2 ข้อมูลดัชนีอัตราเงินเฟ้อ (CPI) จากการพยากรณ์ โดยวิธี Smoothing Techniques แบบ Five Moving Average

(RMSE = 0.8942)

เวลา %	ก.ค. 48	ส.ค. 48	ก.ย. 48	ต.ค. 48	พ.ย. 48	ธ.ค. 48	ม.ค. 49	ก.พ. 49	มี.ค. 49	เม.ย. 49	พ.ค. 49	มิ.ย. 49
0	107.56	107.87	108.07	108.12	108.06	107.94	108.01	108.04	108.03	108.02	108.01	108.02
+1	107.57	107.88	108.08	108.13	108.07	107.95	108.02	108.05	108.04	108.03	108.02	108.03
+2	107.58	107.89	108.09	108.14	108.08	107.96	108.03	108.06	108.05	108.04	108.03	108.04
+3	107.59	107.90	108.10	108.15	108.09	107.97	108.04	108.07	108.06	108.05	108.04	108.05
+4	107.60	107.91	108.11	108.16	108.10	107.98	108.05	108.08	108.07	108.06	108.05	108.06

ตารางผนวกที่ ค2 (ต่อ)

% เวลา	ก.ค. 48	ส.ค. 48	ก.ย. 48	ต.ค. 48	พ.ย. 48	ธ.ค. 48	ม.ค. 49	ก.พ. 49	มี.ค. 49	เม.ย. 49	พ.ค. 49	มิ.ย. 49
+5	107.61	107.92	108.12	108.17	108.11	107.99	108.06	108.09	108.08	108.07	108.06	108.07
+6	107.62	107.93	108.13	108.18	108.12	108.00	108.07	108.10	108.09	108.08	108.07	108.08
+7	107.63	107.94	108.14	108.19	108.13	108.01	108.08	108.11	108.10	108.09	108.08	108.09
+8	107.64	107.95	108.15	108.20	108.14	108.02	108.09	108.12	108.11	108.10	108.09	108.10
+9	107.65	107.96	108.16	108.21	108.15	108.03	108.10	108.13	108.12	108.11	108.10	108.11
+10	107.66	107.97	108.17	108.22	108.16	108.04	108.11	108.14	108.13	108.12	108.11	108.12
-1	107.55	107.86	108.06	108.11	108.05	107.93	108.00	108.03	108.02	108.01	108.00	108.01
-2	107.54	107.85	108.05	108.10	108.04	107.92	107.99	108.02	108.01	108.00	107.99	108.00
-3	107.53	107.84	108.04	108.09	108.03	107.91	107.98	108.01	108	107.99	107.98	107.99
-4	107.52	107.83	108.03	108.08	108.02	107.90	107.97	108.00	107.99	107.98	107.97	107.98
-5	107.51	107.82	108.02	108.07	108.01	107.89	107.96	107.99	107.98	107.97	107.96	107.97
-6	107.50	107.81	108.01	108.06	108.00	107.88	107.95	107.98	107.97	107.96	107.95	107.96
-7	107.49	107.80	108.00	108.05	107.99	107.87	107.94	107.97	107.96	107.95	107.94	107.95
-8	107.48	107.79	107.99	108.04	107.98	107.86	107.93	107.96	107.95	107.94	107.93	107.94
-9	107.47	107.78	107.98	108.03	107.97	107.85	107.92	107.95	107.94	107.93	107.92	107.93
-10	107.46	107.77	107.97	108.02	107.96	107.84	107.91	107.94	107.93	107.92	107.91	107.92