

ภาคผนวก ก
ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา

ตาราง 13

ข้อมูลที่ใช้ในการวิเคราะห์

วันที่/เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	พันธบัตร (บาท)	ส่วนขาด ความเสี่ยง ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV IsmartLTF (บาท)	NAV asp-gltf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
4/1/2553	732.28	1.525642	730.754358	11.4250	10.2939	12.5689	11.6042	9.0116	12.3635	9.6076
5/1/2553	732.11	1.524224	730.585776	11.3887	10.3242	12.5497	11.5997	8.9948	12.3449	9.6130
6/1/2553	735.73	1.518552	734.211448	11.4300	10.3180	12.6118	11.6607	9.0456	12.4143	9.6276
7/1/2553	734.63	1.489484	733.140516	11.4342	10.3222	12.6406	11.6240	9.0736	12.4263	9.6182
8/1/2553	738.96	1.464666	737.495334	11.4767	10.3144	12.7111	11.7132	9.1151	12.4998	9.6446
9/1/2553	738.96	1.464666	737.495334	11.4767	10.3144	12.7111	11.7132	9.1151	12.4998	9.6446
10/1/2553	738.96	1.464666	737.495334	11.4767	10.3144	12.7111	11.7132	9.1151	12.4998	9.6446
11/1/2553	746.95	1.457575	745.492425	11.5243	10.3200	12.7678	11.8584	9.1542	12.6172	9.6896
12/1/2553	745.24	1.444810	743.795190	11.5363	10.3458	12.7579	11.7947	9.1380	12.5597	9.6818
13/1/2553	746.74	1.443392	745.296608	11.5391	10.3326	12.7796	11.8122	9.1527	12.6079	9.6823
14/1/2553	749.42	1.456157	747.963843	11.6166	10.3453	12.8211	11.8573	9.1973	12.6555	9.6984
15/1/2553	746.52	1.463012	745.056988	11.5774	10.3344	12.7387	11.7918	9.1459	12.5652	9.6762
16/1/2553	746.52	1.463012	745.056988	11.5774	10.3344	12.7387	11.7918	9.1459	12.5652	9.6762
17/1/2553	746.52	1.463012	745.056988	11.5774	10.3344	12.7387	11.7918	9.1459	12.5652	9.6762
18/1/2553	746.89	1.468921	745.421079	11.5561	10.3344	12.7080	11.7870	9.1230	12.5289	9.6749
19/1/2553	736.48	1.476248	735.003752	11.4587	10.3699	12.5334	11.5936	9.0069	12.3809	9.6297

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่/เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	ดัชนีตลาด พันธบัตร (บาท)	ส่วนขนาด ความเสี่ยง ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV IsmartLTF (บาท)	NAV asp-gltf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
20/1/2553	731.80	1.478848	730.321152	11.4306	10.3806	12.4711	11.5195	8.9720	12.3129	9.6060
21/1/2553	718.99	1.491611	717.498389	11.2790	10.3525	12.2135	11.2532	8.8255	12.0579	9.5233
22/1/2553	714.10	1.489484	712.610516	11.2346	10.3646	12.1076	11.1636	8.7747	11.9761	9.5204
23/1/2553	714.10	1.489484	712.610516	11.2346	10.3646	12.1076	11.1636	8.7747	11.9761	9.5204
24/1/2553	714.10	1.489484	712.610516	11.2346	10.3646	12.1076	11.1636	8.7747	11.9761	9.5204
25/1/2553	710.39	1.500403	708.889597	11.2185	10.3190	12.0446	11.0793	8.7502	11.8611	9.4809
26/1/2553	701.66	1.492793	700.167207	11.1194	10.3559	11.8768	10.9158	8.4927	11.7514	9.4691
27/1/2553	690.46	1.494447	688.965553	10.9360	10.3178	11.6550	10.7532	8.5170	11.5872	9.4108
28/1/2553	689.72	1.484521	688.235479	10.9624	10.3142	11.6462	10.8939	8.5665	11.5231	9.4173
29/1/2553	696.55	1.494447	695.055553	11.0373	10.3681	11.7504	10.8874	8.5649	11.6780	9.4663
30/1/2553	696.55	1.494447	695.055553	11.0373	10.3681	11.7504	10.8874	8.5649	11.6780	9.4663
31/1/2553	696.55	1.494447	695.055553	11.0373	10.3681	11.7504	10.8874	8.5649	11.6780	9.4663
1/2/2553	697.61	1.519261	696.090739	11.0486	10.3714	11.7482	10.7885	8.5191	11.6848	9.4683
2/2/2553	694.07	1.556831	692.513169	11.0367	10.3514	11.6930	11.0742	8.6985	11.6460	9.4396
4/2/2553	702.52	1.585748	700.934252	11.1639	10.3467	11.8978	10.7295	8.4961	11.8266	9.4668
5/2/2553	691.41	1.578803	689.831197	11.0490	10.3839	11.6725	10.6677	8.4432	11.6695	9.4494
6/2/2553	691.41	1.578803	689.831197	11.0490	10.3839	11.6725	10.6677	8.4432	11.6695	9.4494



ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่/เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	พันธบัตร (บาท)	ส่วนทดเชย ความเสี่ย ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV IsmartLTF (บาท)	NAV asp-glf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
7/2/2553	691.41	1.578803	689.831197	11.0490	10.3839	11.6725	10.6677	8.4432	11.6695	9.4494
8/2/2553	688.09	1.580929	686.509071	11.0003	10.3702	11.6225	10.6407	8.4413	11.6333	9.4301
9/2/2553	685.89	1.580929	684.309071	10.9865	10.3566	11.5861	10.6790	8.4691	11.6022	9.4133
10/2/2553	688.41	1.580929	686.829071	11.0144	10.4183	11.6318	10.8162	8.5302	11.6491	9.4587
11/2/2553	695.41	1.588016	693.821984	11.0731	10.4229	11.7466	10.8389	8.5699	11.8033	9.4759
12/2/2553	698.03	1.589433	696.440567	11.1265	10.4438	11.7937	10.6450	8.4432	11.7956	9.4917
13/2/2553	698.03	1.589433	696.440567	11.1265	10.4438	11.7937	10.6450	8.4432	11.7956	9.4917
14/2/2553	698.03	1.589433	696.440567	11.1265	10.4438	11.7937	10.6450	8.4432	11.7956	9.4917
15/2/2553	689.09	1.586598	687.503402	11.0063	10.4178	11.6174	10.7089	8.4940	11.7031	9.4463
16/2/2553	692.73	1.588725	691.141275	11.0586	10.4098	11.6700	10.7963	8.5664	11.7959	9.4471
17/2/2553	697.49	1.586598	695.903402	11.1259	10.4055	11.7680	10.7617	8.5465	11.8319	9.4543
18/2/2553	695.66	1.583764	694.076236	11.1145	10.3944	11.7579	10.8334	8.5847	11.8242	9.4432
20/2/2553	700.44	1.588725	698.851275	11.1383	10.3795	11.8121	10.9362	8.6438	11.8564	9.4532
21/2/2553	700.44	1.588725	698.851275	11.1383	10.3795	11.8121	10.9362	8.6438	11.8564	9.4532
22/2/2553	705.80	1.585181	704.214819	11.2061	10.3743	11.8872	11.1232	8.7544	11.9131	9.4658
23/2/2553	715.58	1.586598	713.993402	11.3066	10.3807	12.0361	11.1199	8.7674	12.0458	9.5151
24/2/2553	715.18	1.587071	713.592929	11.2997	10.4144	12.0555	11.1709	8.7913	12.0663	9.5238

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่/เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	พันธบัตร (บาท)	ส่วนขาดเขต ความเสถียร ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV IsmartLTF (บาท)	NAV asp-gltf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
25/2/2553	717.10	1.580456	715.519544	11.2849	10.4435	12.0601	11.2480	8.8456	12.0748	9.5483
26/2/2553	721.37	1.578803	719.791197	11.3523	10.4529	12.1543	11.4663	8.9688	12.1387	9.5734
27/2/2553	721.37	1.578803	719.791197	11.3523	10.4529	12.1543	11.4663	8.9688	12.1387	9.5734
28/2/2553	721.37	1.578803	719.791197	11.3523	10.4529	12.1543	11.4663	8.9688	12.1387	9.5734
1/3/2553	721.37	1.578803	719.791197	11.3523	10.4529	12.1543	11.4663	8.9688	12.1387	9.5734
2/3/2553	733.19	1.605260	731.584740	11.4609	10.4862	12.3311	11.5163	9.0199	12.2968	9.6488
3/3/2553	735.04	1.609275	733.430725	11.4787	10.4906	12.4194	11.4458	8.9577	12.3762	9.6641
4/3/2553	730.82	1.607858	729.212142	11.4204	10.4424	12.3054	11.3478	8.8728	12.3515	9.6277
5/3/2553	723.96	1.611874	722.348126	11.3286	10.4347	12.1874	11.2884	8.8703	12.2373	9.5884
6/3/2553	723.96	1.611874	722.348126	11.3286	10.4347	12.1874	11.2884	8.8703	12.2373	9.5884
25/2/2553	717.10	1.580456	715.519544	11.2849	10.4435	12.0601	11.2480	8.8456	12.0748	9.5483
26/2/2553	721.37	1.578803	719.791197	11.3523	10.4529	12.1543	11.4663	8.9688	12.1387	9.5734
27/2/2553	721.37	1.578803	719.791197	11.3523	10.4529	12.1543	11.4663	8.9688	12.1387	9.5734
28/2/2553	721.37	1.578803	719.791197	11.3523	10.4529	12.1543	11.4663	8.9688	12.1387	9.5734
1/3/2553	721.37	1.578803	719.791197	11.3523	10.4529	12.1543	11.4663	8.9688	12.1387	9.5734
2/3/2553	733.19	1.605260	731.584740	11.4609	10.4862	12.3311	11.5163	9.0199	12.2968	9.6488
3/3/2553	735.04	1.609275	733.430725	11.4787	10.4906	12.4194	11.4458	8.9577	12.3762	9.6641

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่/เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	พันธบัตร (บาท)	ส่วนต่อเซช ความเสี่ยง ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV 1smartLTF (บาท)	NAV asp-glf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
4/3/2553	730.82	1.607858	729.212142	11.4204	10.4424	12.3054	11.3478	8.8728	12.3515	9.6277
5/3/2553	723.96	1.611874	722.348126	11.3286	10.4347	12.1874	11.2884	8.8703	12.2373	9.5884
6/3/2553	723.96	1.611874	722.348126	11.3286	10.4347	12.1874	11.2884	8.8703	12.2373	9.5884
7/3/2553	723.96	1.611874	722.348126	11.3286	10.4347	12.1874	11.2884	8.8703	12.2373	9.5884
8/3/2553	720.29	1.606441	718.683559	11.3157	10.4185	12.1207	11.2503	8.8343	12.0970	9.5718
9/3/2553	718.77	1.606441	717.163559	11.3118	10.4348	12.1061	11.2777	8.8690	12.1141	9.5715
10/3/2553	720.84	1.609275	719.230725	11.3374	10.4242	12.1689	11.3875	8.9338	12.1822	9.5823
11/3/2553	725.95	1.614944	724.335056	11.3970	10.3765	12.2464	11.5089	9.0299	12.2932	9.5987
12/3/2553	733.34	1.617779	731.722221	11.4833	10.3566	12.3329	11.5255	9.0536	12.3818	9.6396
13/3/2553	733.34	1.617779	731.722221	11.4833	10.3566	12.3329	11.5255	9.0536	12.3818	9.6396
14/3/2553	733.34	1.617779	731.722221	11.4833	10.3566	12.3329	11.5255	9.0536	12.3818	9.6396
15/3/2553	734.83	1.617779	733.212221	11.5050	10.3739	12.3502	11.8359	9.2345	12.3960	9.6510
16/3/2553	752.20	1.614944	750.585056	11.6867	10.3406	12.6007	12.0771	9.3796	12.6964	9.7300
17/3/2553	765.54	1.608567	763.931433	11.8284	10.3974	12.7924	11.9506	9.3090	12.9053	9.8225
18/3/2553	759.02	1.611874	757.408126	11.7525	10.3747	12.7197	12.2341	9.4903	12.8148	9.7711
19/3/2553	774.59	1.603606	772.986394	11.8900	10.3490	12.9691	12.2046	9.4616	13.0952	9.8475
20/3/2553	774.59	1.603606	772.986394	11.8900	10.3490	12.9691	12.2046	9.4616	13.0952	9.8475

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	พันธบัตร (บาท)	ส่วนขยาย ความเสียง ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV lsmartLTF (บาท)	NAV asp-gltf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
21/3/2553	774.59	1.603606	772.986394	11.8900	10.3490	12.9691	12.2046	9.4616	13.0952	9.8475
22/3/2553	772.25	1.596992	770.653008	11.8840	10.4101	12.9456	12.4156	9.5328	13.0809	9.8543
23/3/2553	782.48	1.59652	780.883480	11.9936	10.3550	13.0549	12.4654	9.5982	13.3545	9.8888
24/3/2553	786.54	1.599355	784.940645	12.0616	10.3679	13.1421	12.4366	9.5977	13.5841	9.9101
25/3/2553	784.38	1.597654	782.782346	12.0672	10.3622	13.1102	12.2967	9.5446	13.4852	9.9017
26/3/2553	778.86	1.603606	777.256394	12.0552	10.3671	13.0607	12.1433	9.4160	13.3968	9.8735
27/3/2553	778.86	1.603606	777.256394	12.0552	10.3671	13.0607	12.1433	9.4160	13.3968	9.8735
28/3/2553	778.86	1.603606	777.256394	12.0552	10.3671	13.0607	12.1433	9.4160	13.3968	9.8735
29/3/2553	771.40	1.610693	769.789307	11.9418	10.3794	12.9250	12.4701	9.6116	13.3465	9.8257
30/3/2553	788.80	1.653205	787.146795	12.1350	10.3759	13.1491	12.4347	9.5872	13.5476	9.9265
31/3/2553	787.98	1.653205	786.326795	12.1076	10.3955	13.1263	12.6843	9.7085	13.5065	9.9332
1/4/2553	801.32	1.659817	799.660183	12.2541	10.4457	13.2985	12.7360	9.6988	13.7445	10.0008
2/4/2553	801.15	1.648954	799.501046	12.2640	10.4510	13.2938	12.8405	9.7327	13.7281	10.0077
3/4/2553	801.15	1.648954	799.501046	12.2640	10.4510	13.2938	12.8405	9.7327	13.7281	10.0077
4/4/2553	801.15	1.648954	799.501046	12.2640	10.4510	13.2938	12.8405	9.7327	13.7281	10.0077
5/4/2553	808.15	1.64612	806.503880	12.3071	10.4662	13.3382	12.9378	9.5113	13.8048	10.0640
6/4/2553	808.15	1.64612	806.503880	12.3071	10.4662	13.3382	12.9378	9.5113	13.8048	10.0640

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่/เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	พันธบัตร (บาท)	ส่วนขยาย ความเสียง ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV IsmartLTF (บาท)	NAV asp-gltf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLT5 (บาท)
7/4/2553	812.63	1.654858	810.975142	12.4239	10.4698	13.4697	12.3854	9.5510	13.8228	10.1022
8/4/2553	783.93	1.647254	782.282746	12.1071	10.4863	13.0146	12.0296	9.2653	13.4248	9.9439
9/4/2553	789.66	1.645270	788.014730	12.1506	10.4948	13.1142	11.6393	9.0277	13.5256	9.9723
10/4/2553	789.66	1.645270	788.014730	12.1506	10.4948	13.1142	11.6393	9.0277	13.5256	9.9723
11/4/2553	789.66	1.645270	788.014730	12.1506	10.4948	13.1142	11.6393	9.0277	13.5256	9.9723
12/4/2553	760.90	1.644939	759.255061	11.8474	10.4867	12.7408	11.4952	8.9557	13.1577	9.8607
13/4/2553	760.90	1.644939	759.255061	11.8474	10.4867	12.7408	11.4952	8.9557	13.1577	9.8607
14/4/2553	760.90	1.644939	759.255061	11.8474	10.4867	12.7408	11.4952	8.9557	13.1577	9.8607
15/4/2553	760.90	1.644939	759.255061	11.8474	10.4867	12.7408	11.4952	8.9557	13.1577	9.8607
16/4/2553	736.16	1.631950	734.528050	11.5781	10.4878	12.3637	12.2230	9.3905	12.6804	9.7599
17/4/2553	736.16	1.631950	734.528050	11.5781	10.4878	12.3637	12.2230	9.3905	12.6804	9.7599
18/4/2553	736.16	1.631950	734.528050	11.5781	10.4878	12.3637	12.2230	9.3905	12.6804	9.7599
19/4/2553	726.29	1.631714	724.658286	11.4955	10.4495	12.2615	12.0752	9.3147	12.4265	9.7214
20/4/2553	765.76	1.625101	764.134899	11.9540	10.4966	12.9074	11.9977	9.3593	13.2125	9.8983
21/4/2553	757.85	1.620613	756.229387	11.8667	10.4363	12.7650	12.1900	9.2639	13.0928	9.8457
24/4/2553	754.58	1.602189	752.977811	11.8566	10.5094	12.8618	11.8725	9.2927	13.0391	9.8250
25/4/2553	754.58	1.602189	752.977811	11.8566	10.5094	12.8618	11.8725	9.2927	13.0391	9.8250

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	พันธบัตร (บาท)	ส่วนลด ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV IsmartLTF (บาท)	NAV asp-gtlf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
26/4/2553	764.34	1.595103	762.744897	11.9598	10.4680	12.8192	11.9519	9.1341	13.1889	9.8714
27/4/2553	762.00	1.585417	760.414583	11.9205	10.5043	12.6356	12.1337	9.1860	13.1511	9.8649
28/4/2553	749.49	1.579795	747.910205	11.7506	10.4396	12.7013	12.7776	9.3027	12.9601	9.8284
29/4/2553	753.20	1.582346	751.617654	11.8079	10.4424	13.3018	12.5251	9.7453	13.0521	9.8296
30/4/2553	763.51	1.598646	761.9111354	11.8959	10.4562	13.0221	12.2082	9.5675	13.2316	9.8901
1/5/2553	763.51	1.598646	761.9111354	11.8959	10.4562	13.0221	12.2082	9.5675	13.2316	9.8901
2/5/2553	763.51	1.598646	761.9111354	11.8959	10.4562	13.0221	12.2082	9.5675	13.2316	9.8901
3/5/2553	763.51	1.598646	761.9111354	11.8959	10.4562	13.0221	12.2082	9.5675	13.2316	9.8901
4/5/2553	796.86	1.603606	795.256394	12.3345	10.4435	13.1946	12.3886	9.3438	13.8885	10.0113
5/5/2553	796.86	1.603606	795.256394	12.3345	10.4435	13.1946	12.3886	9.3438	13.8885	10.0113
6/5/2553	785.25	1.616834	783.633166	12.1824	10.4607	13.0795	12.2283	9.4618	13.7339	9.9568
7/5/2553	768.55	1.623447	766.926553	11.9768	10.5055	13.0986	12.2583	9.3560	13.4215	9.8872
8/5/2553	768.55	1.623447	766.926553	11.9768	10.5055	13.0986	12.2583	9.3560	13.4215	9.8872
9/5/2553	768.55	1.623447	766.926553	11.9768	10.5055	13.0986	12.2583	9.3560	13.4215	9.8872
10/5/2553	779.06	1.624864	777.435136	12.0831	10.4828	12.9607	12.1160	9.3869	13.6065	9.9276
11/5/2553	772.09	1.624864	770.465136	11.9646	10.4555	12.8218	12.1413	9.2939	13.5175	9.8970
12/5/2553	773.72	1.600299	772.119701	12.0030	10.4343	12.5736	11.8636	9.2800	13.4891	9.9264

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่/เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ (จุด)	พันธบัตร (บาท)	ส่วนขาดหาย ความเสี่ยง ตลาด	NAV (บาท)	NAV BLTF75 (บาท)	NAV lsmartLTF (บาท)	NAV asp-glf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
13/5/2553	766.55	1.593685	764.956315	11.8859	10.4584	12.2715	11.9551	9.1201	13.3833	9.8816	
14/5/2553	768.79	1.586598	767.203402	11.8399	10.4763	12.4628	12.0777	9.2168	13.4557	9.8758	
15/5/2553	768.79	1.586598	767.203402	11.8399	10.4763	12.4628	12.0777	9.2168	13.4557	9.8758	
16/5/2553	768.79	1.586598	767.203402	11.8399	10.4763	12.4628	12.0777	9.2168	13.4557	9.8758	
17/5/2553	753.26	1.586598	751.673402	11.7286	10.4563	12.5528	11.2779	8.9974	13.1658	9.7938	
18/5/2553	760.11	1.583764	758.526236	11.7797	10.4649	12.7673	11.4252	8.7747	13.3085	9.8366	
19/5/2553	765.54	1.593685	763.946315	11.8273	10.4414	12.5825	11.5482	8.9069	13.3960	9.8616	
20/5/2553	765.54	1.593685	763.946315	11.8273	10.4414	12.5825	11.5482	8.9069	13.3960	9.8616	
21/5/2553	765.54	1.593685	763.946315	11.8273	10.4414	12.5825	11.5482	8.9069	13.3960	9.8616	
22/5/2553	765.54	1.593685	763.946315	11.8273	10.4414	12.5825	11.5482	8.9069	13.3960	9.8616	
23/5/2553	765.54	1.593685	763.946315	11.8273	10.4414	12.5825	11.5482	8.9069	13.3960	9.8616	
24/5/2553	744.31	1.588016	742.721984	11.5752	10.4704	12.7254	11.7927	8.9698	13.0274	9.7594	
25/5/2553	721.29	1.578803	719.711197	11.3479	10.5124	12.9880	11.6271	8.9842	12.7605	9.6676	
26/5/2553	728.94	1.572188	727.367812	11.5552	10.4804	13.0816	11.7411	9.1024	12.9037	9.6900	
27/5/2553	737.28	1.565573	735.714427	11.5603	10.4702	12.8869	12.0037	9.3007	13.2036	9.7363	
28/5/2553	737.28	1.565573	735.714427	11.5603	10.4702	12.8869	12.0037	9.3007	13.2036	9.7363	
29/5/2553	737.28	1.565573	735.714427	11.5603	10.4702	12.8869	12.0037	9.3007	13.2036	9.7363	

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่/เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (บาท)	ส่วนขยาย ความเสถียร ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV IsmartLTF (บาท)	NAV asp-glf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
30/5/2553	737.28	1.565573	735.714427	11.5603	10.4702	12.8869	12.0037	9.3007	13.2036	9.7363
31/5/2553	750.43	1.522806	748.907194	11.7385	10.4794	12.8340	12.1022	9.3752	13.0680	9.8126
1/6/2553	740.92	1.524224	739.395776	11.6096	10.4728	12.9618	11.8798	9.2285	13.2913	9.7537
2/6/2553	749.68	1.518269	748.161731	11.7135	10.5015	13.0352	11.8080	9.1963	13.5740	9.7773
3/6/2553	765.96	1.526209	764.433791	11.9430	10.4811	13.0595	11.9187	9.2808	13.6218	9.8496
4/6/2553	771.48	1.525878	769.954122	12.0420	10.4497	13.2517	11.9848	9.3378	13.4548	9.8756
5/6/2553	771.48	1.525878	769.954122	12.0420	10.4497	13.2517	11.9848	9.3378	13.4548	9.8756
6/6/2553	771.48	1.525878	769.954122	12.0420	10.4497	13.2517	11.9848	9.3378	13.4548	9.8756
7/6/2553	759.85	1.517135	758.332865	11.8772	10.4607	13.2451	11.9924	9.3611	13.3879	9.8204
8/6/2553	757.41	1.525878	755.884122	11.8234	10.4415	13.3484	12.2121	9.4645	13.5226	9.8189
9/6/2553	764.21	1.521388	762.688612	11.9369	10.4362	13.3827	12.1788	9.4206	13.6803	9.8343
10/6/2553	768.16	1.506028	766.653972	11.9601	10.4787	13.4079	12.2933	9.5121	13.7303	9.8341
11/6/2553	769.55	1.524224	768.025776	11.9859	10.4412	13.6323	12.2963	9.5408	14.0264	9.8428
12/6/2553	769.55	1.524224	768.025776	11.9859	10.4412	13.6323	12.2963	9.5408	14.0264	9.8428
13/6/2553	769.55	1.524224	768.025776	11.9859	10.4412	13.6323	12.2963	9.5408	14.0264	9.8428
14/6/2553	781.13	1.525642	779.604358	12.1153	10.4719	13.5863	12.2773	9.5893	14.0833	9.8756
15/6/2553	780.37	1.524224	778.845776	12.0965	10.4432	13.6646	12.5588	9.7406	14.0345	9.8678

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่/เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	พันธบัตร (บาท)	ส่วนขาด ความเสี่ยง ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV IsmartLTF (บาท)	NAV asp-glrf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
16/6/2553	786.64	1.527059	785.112941	12.1357	10.4467	13.4537	12.4951	9.6899	14.0795	9.9165
17/6/2553	789.34	1.532494	787.807506	12.1645	10.4280	13.4446	12.5574	9.7131	13.9812	9.9130
18/6/2553	791.85	1.539110	790.310890	12.1761	10.4605	13.5966	12.3479	9.5430	14.1757	9.9304
19/6/2553	791.85	1.539110	790.310890	12.1761	10.4605	13.5966	12.3479	9.5430	14.1757	9.9304
20/6/2553	791.85	1.539110	790.310890	12.1761	10.4605	13.5966	12.3479	9.5430	14.1757	9.9304
21/6/2553	806.07	1.540764	804.529236	12.3435	10.4384	13.5371	12.3685	9.5466	14.1816	9.9790
22/6/2553	804.13	1.544072	802.585928	12.2893	10.4296	13.5078	12.5264	9.6372	14.2925	9.9636
23/6/2553	806.52	1.545726	804.974274	12.3589	10.4716	13.5698	12.4184	9.5953	14.0310	9.9647
24/6/2553	793.19	1.545726	791.644274	12.1215	10.4632	13.6016	12.3703	9.5653	14.0467	9.9109
25/6/2553	793.67	1.548042	792.121958	12.1819	10.4549	13.7844	12.4469	9.5875	14.2250	9.9040
26/6/2553	793.67	1.548042	792.121958	12.1819	10.4549	13.7844	12.4469	9.5875	14.2250	9.9040
27/6/2553	793.67	1.548042	792.121958	12.1819	10.4549	13.7844	12.4469	9.5875	14.2250	9.9040
28/6/2553	804.40	1.550688	802.849312	12.2463	10.4450	13.7530	12.4273	9.6012	14.1261	9.9402
29/6/2553	799.09	1.555981	797.534019	12.1895	10.4402	13.7950	12.6643	9.7353	14.0332	9.9169
30/6/2553	797.31	1.558958	795.751042	12.1645	10.4842	13.8166	12.6290	9.7032	14.0888	9.8916
1/7/2553	797.31	1.558958	795.751042	12.1645	10.4842	13.8166	12.6290	9.7032	14.0888	9.8916
2/7/2553	802.57	1.569707	801.000293	12.1973	10.4737	13.7665	12.7026	9.7337	14.0670	9.9050

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่/เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	ดัชนีตลาด พันธบัตร (บาท)	ส่วนลดขาย ความเสียง ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV IsmartLTF (บาท)	NAV asp-gltf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
3/7/2553	802.57	1.569707	801.000293	12.1973	10.4737	13.7665	12.7026	9.7337	14.0670	9.9050
4/7/2553	802.57	1.569707	801.000293	12.1973	10.4737	13.7665	12.7026	9.7337	14.0670	9.9050
5/7/2553	804.03	1.606913	802.423087	12.1758	10.4717	13.7038	12.7553	9.7257	14.2956	9.8982
6/7/2553	815.52	1.654858	813.865142	12.3387	10.4830	13.7220	12.7411	9.7138	14.2367	9.9511
7/7/2553	814.68	1.677999	813.002001	12.3449	10.4721	13.7540	12.6789	9.7082	14.4789	9.9542
8/7/2553	817.57	1.732537	815.837463	12.3796	10.5018	13.9064	12.6508	9.7074	14.5231	9.9553
9/7/2553	820.60	1.757322	818.842678	12.3733	10.4950	13.9329	12.6879	9.7687	14.4117	9.9558
10/7/2553	820.60	1.757322	818.842678	12.3733	10.4950	13.9329	12.6879	9.7687	14.4117	9.9558
11/7/2553	820.60	1.757322	818.842678	12.3733	10.4950	13.9329	12.6879	9.7687	14.4117	9.9558
12/7/2553	819.61	1.775496	817.834504	12.3647	10.4752	13.8404	12.8008	9.8022	14.3684	9.9484
13/7/2553	817.35	1.770539	815.579461	12.3275	10.4807	14.0522	12.8539	9.7724	14.5267	9.9308
14/7/2553	819.54	1.797963	817.742037	12.2939	10.4875	14.0822	12.7534	9.8767	14.4687	9.9416
15/7/2553	821.02	1.837321	819.182679	12.3003	10.4744	14.1805	12.8566	9.9539	14.5454	9.9426
16/7/2553	827.54	1.841568	825.698432	12.3675	10.4873	14.4418	12.9252	10.0369	14.6805	9.9611
17/7/2553	827.54	1.841568	825.698432	12.3675	10.4873	14.4418	12.9252	10.0369	14.6805	9.9611
18/7/2553	827.54	1.841568	825.698432	12.3675	10.4873	14.4418	12.9252	10.0369	14.6805	9.9611
19/7/2553	830.40	1.841568	828.558432	12.4011	10.5191	14.4198	13.0675	10.1977	14.5878	9.9729

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	พันบิตร (บาท)	ส่วนต่อชื่อย ความถี่ ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV IsmartLTF (บาท)	NAV asp-gltf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
20/7/2553	824.41	1.841568	822.568432	12.4067	10.4832	14.4708	13.2702	10.2253	14.8018	9.9494
21/7/2553	830.93	1.851477	829.078523	12.5672	10.4855	14.4827	13.3189	10.2415	14.8491	9.9666
22/7/2553	833.01	1.854308	831.155692	12.6172	10.4823	14.6019	13.3029	10.2337	14.8371	9.9818
23/7/2553	840.24	1.852893	838.387107	12.7293	10.5032	14.5807	13.3365	10.3055	14.9156	10.0323
24/7/2553	840.24	1.852893	838.387107	12.7293	10.5032	14.5807	13.3365	10.3055	14.9156	10.0323
25/7/2553	840.24	1.852893	838.387107	12.7293	10.5032	14.5807	13.3365	10.3055	14.9156	10.0323
26/7/2553	840.24	1.852893	838.387107	12.7293	10.5032	14.5807	13.3365	10.3055	14.9156	10.0323
27/7/2553	853.68	1.852893	851.827107	12.8107	10.4871	14.6295	13.4572	10.3105	14.9354	10.0970
28/7/2553	853.78	1.884032	851.895968	12.8064	10.4839	14.8379	13.4555	10.3410	14.9875	10.1019
29/7/2553	854.59	1.896769	852.693231	12.8079	10.4889	14.7851	13.4850	10.4437	15.0407	10.1005
30/7/2553	855.83	1.914223	853.915777	12.8239	10.4494	14.7857	13.6005	10.4335	15.2099	10.1040
1/8/2553	855.83	1.914223	853.915777	12.8239	10.4494	14.7857	13.6005	10.4335	15.2099	10.1040
2/8/2553	855.83	1.914223	853.915777	12.8239	10.4494	14.7857	13.6005	10.4335	15.2099	10.1040
2/8/2553	863.18	1.932147	861.247853	12.864	10.4576	14.5568	13.5971	10.4409	15.2426	10.1283
3/8/2553	864.48	1.978836	862.501164	12.8709	10.4452	14.5920	13.5775	10.3058	15.3802	10.1331
4/8/2553	867.34	1.984494	865.355506	12.9028	10.4750	14.5935	13.3568	10.3308	15.5037	10.1440
5/8/2553	874.92	1.984494	872.935506	12.9933	10.4693	14.7053	13.3480	10.3363	15.4799	10.1635

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่/เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	ดัชนีตลาด พันธบัตร (บาท)	ส่วนจดทะเบียน ความเสี่ยง ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV IsmartLTF (บาท)	NAV asp-gltf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
6/8/2553	875.07	1.990153	873.079847	12.9715	10.4858	14.9529	13.3452	10.4119	15.4927	10.1603
7/8/2553	875.07	1.990153	873.079847	12.9715	10.4858	14.9529	13.3452	10.4119	15.4927	10.1603
8/8/2553	875.07	1.990153	873.079847	12.9715	10.4858	14.9529	13.3452	10.4119	15.4927	10.1603
9/8/2553	875.18	1.991567	873.188433	12.9617	10.4484	15.1333	13.4610	10.5740	15.3642	10.1546
10/8/2553	861.95	1.994396	859.955604	12.8113	10.4550	15.1779	13.7036	10.6573	15.3741	10.1112
11/8/2553	862.16	1.995811	860.164189	12.8543	10.4330	15.0722	13.9241	10.6945	15.3089	10.1094
12/8/2553	862.16	1.995811	860.164189	12.8543	10.4330	15.0722	13.9241	10.6945	15.3089	10.1094
13/8/2553	862.16	1.995811	860.164189	12.8543	10.4330	15.0722	13.9241	10.6945	15.3089	10.1094
14/8/2553	862.16	1.995811	860.164189	12.8543	10.4330	15.0722	13.9241	10.6945	15.3089	10.1094
15/8/2553	862.16	1.995811	860.164189	12.8543	10.4330	15.0722	13.9241	10.6945	15.3089	10.1094
16/8/2553	860.55	1.988502	858.561498	12.9374	10.4629	14.9170	13.9286	10.6882	15.3371	10.1145
17/8/2553	865.78	2.009956	863.770044	13.0303	10.4450	14.9682	13.8829	10.6533	15.6773	10.1343
18/8/2553	880.02	2.007127	878.012873	13.1572	10.4914	15.2327	13.8067	10.5734	15.9838	10.2028
19/8/2553	891.23	1.998404	889.231596	13.2821	10.5150	15.3826	13.6699	10.5935	16.0205	10.2446
20/8/2553	893.92	1.993453	891.926547	13.2920	10.4644	15.4229	13.6889	10.7556	16.0405	10.2619
21/8/2553	893.92	1.993453	891.926547	13.2920	10.4644	15.4229	13.6889	10.7556	16.0405	10.2619
22/8/2553	893.92	1.993453	891.926547	13.2920	10.4644	15.4229	13.6889	10.7556	16.0405	10.2619

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่/เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	พันธบัตร (บาท)	ส่วนชดเชย ความเสี่ยง ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV IsmartLTF (บาท)	NAV asp-gltf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
23/8/2553	894.78	1.980250	892.799750	13.3082	10.4572	15.5785	13.9423	10.8620	16.0437	10.2551
24/8/2553	890.45	1.973177	888.476823	13.2495	10.4619	15.6164	14.0927	10.8980	16.0137	10.2347
25/8/2553	884.51	1.988502	882.521498	13.1963	10.4648	15.6941	14.3645	10.9958	16.1653	10.2176
26/8/2553	886.10	1.998404	884.101596	13.2314	10.4717	15.6154	14.3737	11.0293	16.4394	10.2056
27/8/2553	900.37	1.991803	898.378197	13.5222	10.4775	15.5986	14.5512	11.0840	16.5162	10.2651
28/8/2553	900.37	1.991803	898.378197	13.5222	10.4775	15.5986	14.5512	11.0840	16.5162	10.2651
29/8/2553	900.37	1.991803	898.378197	13.5222	10.4775	15.5986	14.5512	11.0840	16.5162	10.2651
30/8/2553	909.65	2.007127	907.642873	13.6701	10.4519	15.6152	14.5770	11.0519	16.6459	10.3092
31/8/2553	913.19	1.994396	911.195604	13.7669	10.4375	15.6534	14.5259	11.0144	16.8273	10.3330
1/9/2553	919.34	1.971998	917.368002	13.8412	10.4435	15.6952	14.5179	11.0091	17.0255	10.3728
2/9/2553	920.54	1.981665	918.558335	13.8502	10.4382	15.9442	14.5131	11.0222	17.2577	10.3792
3/9/2553	929.90	1.980250	927.919750	13.9176	10.4304	15.6638	14.5001	11.0489	17.2094	10.4297
4/9/2553	929.90	1.980250	927.919750	13.9176	10.4304	15.6638	14.5001	11.0489	17.2094	10.4297
5/9/2553	929.90	1.980250	927.919750	13.9176	10.4304	15.6638	14.5001	11.0489	17.2094	10.4297
6/9/2553	931.52	1.985909	929.534091	13.8271	10.4205	15.6460	14.7488	11.2084	16.9580	10.4504
7/9/2553	923.89	1.978836	921.911164	13.8573	10.4111	15.7216	14.4453	11.0284	16.8771	10.4209
8/9/2553	923.88	1.978836	921.901164	13.8366	10.4222	15.7564	14.4107	11.0159	16.8378	10.4243

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่/เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	พันธบัตร (บาท)	ส่วนลดชย ความเต็ม ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV IsmartLTF (บาท)	NAV asp-gltf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
9/9/2553	921.49	1.976006	919.513994	13.7719	10.4010	15.7680	14.4631	11.0411	16.8021	10.4124
10/9/2553	924.57	1.976006	922.593994	13.8240	10.4319	16.0424	14.4239	11.0007	17.0037	10.4269
11/9/2553	924.57	1.976006	922.593994	13.8240	10.4319	16.0424	14.4239	11.0007	17.0037	10.4269
12/9/2553	924.57	1.976006	922.593994	13.8240	10.4319	16.0424	14.4239	11.0007	17.0037	10.4269
13/9/2553	937.04	1.994396	935.045604	14.0110	10.4333	16.1404	14.4488	10.9737	16.7001	10.4758
14/9/2553	921.39	1.987324	919.402676	13.8109	10.4380	16.1994	14.7022	11.1235	16.7296	10.4136
15/9/2553	921.10	2.002883	919.097117	13.7530	10.4277	16.2506	14.8690	11.2466	16.8479	10.4060
16/9/2553	924.81	2.008541	922.801459	13.8357	10.4135	16.4519	14.9257	11.2938	16.7835	10.4192
17/9/2553	923.57	1.998640	921.571360	13.8714	10.4127	16.4128	15.0177	11.3477	16.7444	10.3988
18/9/2553	923.57	1.998640	921.571360	13.8714	10.4127	16.4128	15.0177	11.3477	16.7444	10.3988
19/9/2553	923.57	1.998640	921.571360	13.8714	10.4127	16.4128	15.0177	11.3477	16.7444	10.3988
20/9/2553	923.06	2.002883	921.057117	13.8742	10.4135	16.5758	15.2438	11.5241	16.9476	10.4134
21/9/2553	937.21	2.005712	935.204288	14.0523	10.4558	16.6855	15.2022	11.5274	17.1596	10.4517
22/9/2553	945.00	2.008541	942.991459	14.1556	10.4339	16.6926	15.4372	11.6280	17.3853	10.4828
23/9/2553	947.10	2.006655	945.093345	14.2084	10.5168	16.4438	15.5852	11.6983	17.4156	10.4827
24/9/2553	951.90	2.009956	949.890044	14.2503	10.4236	16.5334	15.3675	11.6747	17.5002	10.5139
25/9/2553	951.90	2.009956	949.890044	14.2503	10.4236	16.5334	15.3675	11.6747	17.5002	10.5139

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่/เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (บาท)	ส่วนจดทะเบียน ความเสียง ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV IsmartLTF (บาท)	NAV asp-glf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
26/9/2553	951.90	2.009956	949.890044	14.2503	10.4236	16.5334	15.3675	11.6747	17.5002	10.5139
27/9/2553	962.47	2.003355	960.466645	14.4232	10.4171	16.7320	15.4919	11.5561	17.3548	10.5608
28/9/2553	959.27	1.998640	957.271360	14.4058	10.4403	16.6004	15.6802	11.5980	17.5070	10.5496
29/9/2553	969.65	2.000054	967.649946	14.5095	10.5024	16.4613	15.5178	11.7508	17.5187	10.5775
30/9/2553	975.30	2.005005	973.294995	14.5245	10.4442	16.6963	15.3865	11.6699	17.8320	10.6265
1/10/2553	978.58	2.008541	976.571459	14.4976	10.4644	16.7434	15.7050	11.7213	17.3946	10.6273
2/10/2553	978.58	2.008541	976.571459	14.4976	10.4644	16.7434	15.7050	11.7213	17.3946	10.6273
3/10/2553	978.58	2.008541	976.571459	14.4976	10.4644	16.7434	15.7050	11.7213	17.3946	10.6273
4/10/2553	964.22	2.009956	962.210044	14.3668	10.4239	17.0034	15.6447	11.6930	17.5424	10.6070
5/10/2553	969.28	2.022685	967.257315	14.3998	10.4136	16.9520	15.8843	11.8423	17.7958	10.5803
6/10/2553	979.00	2.021271	976.978729	14.5136	10.4532	16.9639	15.8833	11.8328	17.6026	10.6283
7/10/2553	970.90	2.017028	968.882972	14.4643	10.4206	16.7378	15.9279	11.8406	17.4539	10.6032
8/10/2553	963.19	2.026928	961.163072	14.3670	10.4328	16.8759	15.6350	11.7175	17.6031	10.5965
9/10/2553	963.19	2.026928	961.163072	14.3670	10.4328	16.8759	15.6350	11.7175	17.6031	10.5965
10/10/2553	963.19	2.026928	961.163072	14.3670	10.4328	16.8759	15.6350	11.7175	17.6031	10.5965
11/10/2553	977.85	2.017028	975.832972	14.5034	10.4434	16.8549	15.6676	11.8125	17.5654	10.6330
12/10/2553	977.08	2.005995	975.074005	14.4763	10.4512	16.9365	15.7609	11.7831	17.8117	10.6368

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่/เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	พันธบัตร (บาท)	ส่วนขยาย ความเสี่ยง ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV IsmartLTF (บาท)	NAV asp-gltf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
13/10/2553	992.60	2.011370	990.588630	14.5677	10.4928	17.0344	15.8310	11.7910	17.7701	10.6870
14/10/2553	993.72	2.014199	991.705801	14.5263	10.4338	17.0839	15.5951	11.8364	17.8113	10.6881
15/10/2553	997.15	1.995811	995.154189	14.4877	10.4949	16.8743	15.6234	11.8631	17.4998	10.7275
16/10/2553	997.15	1.995811	995.154189	14.4877	10.4949	16.8743	15.6234	11.8631	17.4998	10.7275
17/10/2553	997.15	1.995811	995.154189	14.4877	10.4949	16.8743	15.6234	11.8631	17.4998	10.7275
18/10/2553	984.03	1.964689	982.065311	14.3899	10.4868	16.9231	15.5456	11.7266	17.5588	10.6516
19/10/2553	989.27	1.970348	987.299652	14.4861	10.5124	16.8957	15.8911	11.7611	17.6316	10.6777
20/10/2553	988.11	1.970348	986.139652	14.4491	10.4693	17.2044	15.9342	11.7231	17.7342	10.6701
21/10/2553	988.80	1.970348	986.829652	14.4507	10.4783	17.1957	16.0588	11.8918	17.8083	10.6769
22/10/2553	992.24	1.973177	990.266823	14.5922	10.4873	17.2920	16.4816	11.8885	17.9678	10.7090
23/10/2553	992.24	1.973177	990.266823	14.5922	10.4873	17.2920	16.4816	11.8885	17.9678	10.7090
24/10/2553	992.24	1.973177	990.266823	14.5922	10.4873	17.2920	16.4816	11.8885	17.9678	10.7090
25/10/2553	992.24	1.973177	990.266823	14.5922	10.4873	17.2920	16.4816	11.8885	17.9678	10.7090
26/10/2553	996.04	1.978836	994.061164	14.6361	10.4551	17.5425	16.6643	12.0549	17.7371	10.6904
27/10/2553	983.96	1.984494	981.975506	14.4931	10.4984	17.6840	16.8205	12.1591	17.8501	10.6587
28/10/2553	987.23	1.984494	985.245506	14.5500	10.4784	17.8644	16.7295	12.2006	17.7960	10.6673
29/10/2553	984.46	1.984494	982.475506	14.5077	10.4548	17.8059	16.6617	12.1825	18.0815	10.6630

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่/เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	พันธบัตร (บาท)	ส่วนชดเชย ความเสี่ยง ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV IsmartLTF (บาท)	NAV asp-gltf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
30/10/2553	984.46	1.984494	982.475506	14.5077	10.4548	17.8059	16.6617	12.1825	18.0815	10.6630
31/10/2553	984.46	1.984494	982.475506	14.5077	10.4548	17.8059	16.6617	12.1825	18.0815	10.6630
1/11/2553	1,003.24	1.988738	1001.251262	14.6551	10.4936	17.7132	16.3621	12.1104	18.1590	10.7296
2/11/2553	1,005.58	2.024100	1003.555900	14.6336	10.4601	17.5017	16.1462	11.9261	18.2756	10.7384
3/11/2553	1,014.20	2.052856	1012.147144	14.6677	10.5177	17.3677	16.3656	11.8153	18.4959	10.7841
4/11/2553	1,031.61	2.066525	1029.543475	14.8454	10.4839	17.4940	15.9447	11.8943	18.8839	10.8662
5/11/2553	1,040.45	2.069353	1038.380647	14.9204	10.5309	17.0332	15.8111	11.6193	18.7743	10.9616
6/11/2553	1,040.45	2.069353	1038.380647	14.9204	10.5309	17.0332	15.8111	11.6193	18.7743	10.9616
7/11/2553	1,040.45	2.069353	1038.380647	14.9204	10.5309	17.0332	15.8111	11.6193	18.7743	10.9616
8/11/2553	1,049.79	2.077837	1047.712163	14.9798	10.5192	16.8139	16.1079	11.4804	18.7805	10.9312
9/11/2553	1,047.55	2.075009	1045.474991	14.9858	10.4952	17.0427	16.1648	11.6260	18.4525	10.9228
10/11/2553	1,042.28	2.075952	1040.204048	14.8616	10.5532	17.1702	16.3371	11.6926	18.1677	10.8422
11/11/2553	1,029.86	2.077837	1027.782163	14.6821	10.5105	17.3868	16.1784	11.7872	18.3557	10.8248
12/11/2553	1,018.86	2.090798	1016.769202	14.5593	10.5064	17.2042	16.0792	11.7000	17.8816	10.8543
13/11/2553	1,018.86	2.090798	1016.769202	14.5593	10.5064	17.2042	16.0792	11.7000	17.8816	10.8543
14/11/2553	1,018.86	2.090798	1016.769202	14.5593	10.5064	17.2042	16.0792	11.7000	17.8816	10.8543
15/11/2553	1,029.14	2.079251	1027.060749	14.6441	10.5124	17.1064	15.8691	11.6837	17.7461	10.7760

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่/เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	พันธบัตร (บาท)	ส่วนขาดชย ความเสี่ย ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV 1smartLTF (บาท)	NAV asp-gltf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
16/11/2553	1,000.73	2.090798	998.639202	14.4420	10.5541	16.9210	15.7738	11.6097	17.9736	10.7393
17/11/2553	990.13	2.091128	988.038872	14.2718	10.5437	16.8388	16.1320	11.5624	18.0041	10.7713
18/11/2553	1,004.72	2.090563	1002.629437	14.4397	10.5026	17.1365	15.9944	11.6962	18.1808	10.8183
19/11/2553	1,008.77	2.090563	1006.679437	14.5190	10.5127	17.0833	16.2454	11.6036	17.9341	10.8305
20/11/2553	1,008.77	2.090563	1006.679437	14.5190	10.5127	17.0833	16.2454	11.6036	17.9341	10.8305
21/11/2553	1,008.77	2.090563	1006.679437	14.5190	10.5127	17.0833	16.2454	11.6036	17.9341	10.8305
22/11/2553	1,019.19	2.091976	1017.098024	14.6341	10.4747	17.2990	16.4614	11.7270	17.7919	10.8002
23/11/2553	1,009.47	2.097396	1007.372604	14.5296	10.4867	17.5127	16.5100	11.8465	17.5652	10.7906
24/11/2553	1,005.97	2.100695	1003.869305	14.4974	10.4840	17.5790	16.5978	11.9006	17.3938	10.7791
25/11/2553	996.42	2.095747	994.324253	14.3946	10.4712	17.7235	16.3354	12.0054	17.7971	10.7544
26/11/2553	991.71	2.102015	989.607985	14.3751	10.4727	17.3910	16.5078	11.8096	17.8372	10.8105
27/11/2553	991.71	2.102015	989.607985	14.3751	10.4727	17.3910	16.5078	11.8096	17.8372	10.8105
28/11/2553	991.71	2.102015	989.607985	14.3751	10.4727	17.3910	16.5078	11.8096	17.8372	10.8105
29/11/2553	1,009.00	2.100695	1006.899305	14.4805	10.4904	17.5812	16.4871	11.8862	18.0283	10.7932
30/11/2553	1,005.12	2.105643	1003.014357	14.4191	10.4894	17.5149	16.5301	11.8635	18.2146	10.8287
1/12/2553	1,017.64	2.130713	1015.509287	14.5849	10.4837	17.5525	16.4964	11.9253	18.2140	10.8913
2/12/2553	1,031.97	2.160066	1029.809934	14.7039	10.4942	17.4840	16.3557	11.9218	18.3522	10.8927

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่/เดือน/ปี พ.ศ.	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (จุด)	ดัชนีตลาด หลักทรัพย์ (บาท)	ส่วนต่อ ความถี่ ตลาด	NAV BLTF75 (บาท)	NAV IsmartLTF (บาท)	NAV asp-glf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
3/12/2553	1,034.06	2.155119	1031.904881	14.7305	10.4685	17.3494	16.2294	11.8665	18.0609	10.9089
4/12/2553	1,034.06	2.155119	1031.904881	14.7305	10.4685	17.3494	16.2294	11.8665	18.0609	10.9089
5/12/2553	1,034.06	2.155119	1031.904881	14.7305	10.4685	17.3494	16.2294	11.8665	18.0609	10.9089
6/12/2553	1,034.06	2.155119	1031.904881	14.7305	10.4685	17.3494	16.2294	11.8665	18.0609	10.9089
7/12/2553	1,040.72	2.170289	1038.549711	14.7512	10.4804	17.2835	15.9855	11.7908	18.2817	10.8443
8/12/2553	1,025.08	2.201286	1022.878714	14.5845	10.4787	17.1087	16.1279	11.6681	18.3167	10.8930
9/12/2553	1,035.85	2.237552	1033.612448	14.6542	10.4957	17.1926	16.1899	11.7550	18.4439	10.8784
10/12/2553	1,035.85	2.237552	1033.612448	14.6542	10.4957	17.1926	16.1899	11.7550	18.4439	10.8784
11/12/2553	1,035.85	2.237552	1033.612448	14.6542	10.4957	17.1926	16.1899	11.7550	18.4439	10.8784
12/12/2553	1,035.85	2.237552	1033.612448	14.6542	10.4957	17.1926	16.1899	11.7550	18.4439	10.8784
13/12/2553	1,033.32	2.224836	1031.095164	14.6224	10.5226	17.2632	16.2013	11.7697	18.5620	10.8940
14/12/2553	1,037.41	2.288644	1035.121356	14.6895	10.5219	17.2159	16.1940	11.7767	18.2387	10.8877
15/12/2553	1,035.47	2.357845	1033.112155	14.6756	10.4963	17.1541	16.1440	11.7700	18.0067	10.8560
16/12/2553	1,029.60	2.346313	1027.253687	14.6883	10.5030	17.3240	16.3003	11.7447	17.7551	10.8337
17/12/2553	1,022.46	2.387259	1020.072741	14.5794	10.4940	17.4275	16.3811	11.8069	17.8920	10.7780
18/12/2553	1,022.46	2.387259	1020.072741	14.5794	10.4940	17.4275	16.3811	11.8069	17.8920	10.7780
19/12/2553	1,022.46	2.387259	1020.072741	14.5794	10.4940	17.4275	16.3811	11.8069	17.8920	10.7780

ตาราง 13 (ต่อ)

วันที่เดือนปี พ.ศ.	ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ (จุด)	ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ (บาท)	ส่วนจดทะเบียน	NAV BLTF75 (บาท)	NAV lsmartLTF (บาท)	NAV asp-gltf (บาท)	NAV MscoreLTF (บาท)	NAV P-LTF (บาท)	NAV SCBLT3 (บาท)	NAV SCBLTS (บาท)
20/12/2553	1,006.51	2,388,671	1004.121329	14,4773	10.5236	17.3584	16.3135	11.9088	17.9464	10.8074
21/12/2553	1,013.19	2,389,142	1010.800858	14,4854	10.5436	17.7235	16.4269	11.8518	17.9989	10.8405
22/12/2553	1,019.14	2,375,965	1016.764035	14,5156	10.5826	17.3910	16.3323	11.8465	17.9833	10.8463
23/12/2553	1,021.27	2,373,988	1018.896012	14,5202	10.5566	17.5812	16.6602	11.9006	17.9006	10.8336
24/12/2553	1,021.99	2,379,259	1019.610741	14,5171	10.5433	17.5149	16.5643	12.0054	18.1668	10.8289
25/12/2553	1,021.99	2,379,259	1019.610741	14,5171	10.5433	17.5149	16.5643	12.0054	18.1668	10.8289
26/12/2553	1,021.99	2,379,259	1019.610741	14,5171	10.5433	17.5149	16.5643	12.0054	18.1668	10.8289
27/12/2553	1,019.46	2,375,965	1017.084035	14,4894	10.5854	17.5525	16.7976	11.8096	18.2876	10.8587
28/12/2553	1,028.33	2,377,941	1025.952059	14,5356	10.6012	17.8339	17.0898	11.8862	18.4309	10.8900
29/12/2553	1,034.59	2,380,906	1032.209094	14,6141	10.3528	17.8306	17.1432	11.8635	18.4439	10.8880
30/12/2553	1,032.76	2,383,024	1030.376976	14,5696	10.5280	17.8890	17.2448	11.9253	18.5620	10.8940

ที่มา: จาก 1. ดัชนีตลาดหลักทรัพย์, โดย ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย, 2553ง, คำนวณ 5 ตุลาคม 2553, จาก http://www.set.or.th/th/market/market_statistics.html#monthly

2. มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ, โดย สมาคมบริษัทจัดการลงทุน, 2553ง, คำนวณ 5 ตุลาคม 2553, จาก http://www.thaimutualfund.com/AIMC/aimc_navCenter.jsp

3. มูลค่าอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล, โดย สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย, 2553, คำนวณเมื่อ 5 ตุลาคม 2553, จาก http://www.thaibma.or.th/bond_info.html

ตาราง 14

สัดส่วนการลงทุนกองทุนหุ้นระยะยาวแบ่งตามกลุ่มอุตสาหกรรม (หน่วย: ร้อยละ)

กองทุนรวม	สถาบันการเงิน	พลังงาน	การสื่อสาร	วัสดุก่อสร้าง	ปิโตรเคมี	อื่นๆ
กองทุนเปิดบัวหลวง หุ้นระยะยาว 75/25	37.17	15.44	4.52	4.96		37.91
กองทุนเปิดวรรณ เอเอ็ม สมาร์ท หุ้นระยะยาว	36.70	27.65		5.45	4.29	25.91
กองทุนเปิดเอสเซท พลัส หุ้นระยะยาวทวิกำไร	35.28	34.67	5.02		8.06	16.97
กองทุนเปิดพิลลipsis หุ้นระยะยาว	33.42	22.66	8.13	4.56		31.23
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ หุ้นระยะยาว สมาร์ท	31.90	27.59	4.48	5.44	4.68	25.91
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ หุ้นระยะยาว เอ็มเอไอ	29.80	23.19			10.66	36.35
กองทุนเปิดแมนู เดฟฟ์ สตรีงส์ คอร์ป หุ้นระยะยาว	21.53	19.63	4.82	6.45	5.14	42.43

ที่มา. จาก สัดส่วนการลงทุนกองทุนหุ้นระยะยาวแบ่งตามกลุ่มอุตสาหกรรม, โดย ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย, 2553จ, คำนวณเมื่อ 24

สิงหาคม 2553, จาก http://www.sec.or.th/infocenter/report/Content_0000000138.jsp?categoryID=CAT000569&lang=th

ภาคผนวก ข
ผลการคำนวณค่าสมการถดถอยด้วยวิธี OLS

ตาราง 15

ผลการทดสอบความสัมพันธ์ปัจจัยที่กำหนดมูลค่าสินทรัพย์สุทธิของกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) ที่ลงทุนในหุ้นกลุ่มสถาบันการเงิน ด้วยวิธีกำลังสองน้อยที่สุด

Dependent Variable: R1SMARTLTF

Method: Least Squares

Date: 05/16/11 Time: 13:40

Sample: 1/01/2010 12/30/2010

Included observations: 364

Variable	Coefficient	Std. Error	t Statistic	Prob.
C	0.360182	0.113476	3.174073	0.0016
RF	5.439270	0.081562	66.68894	0.0000
RP	0.000117	0.000174	0.674282	0.5006

R squared	0.944834	Mean dependent var	6.946196
Adjusted R squared	0.944528	SD dependent var	4.938962
SE of regression	1.163246	Akaike info criterion	3.148513
Sum squared resid	488.4839	Schwarz criterion	3.180633
Log likelihood	-570.0294	F statistic	3091.437
Durbin-Watson stat	0.508469	Prob (F statistic)	0.000000

ที่มา. จากการคำนวณ

ตาราง 16

ผลการทดสอบความสัมพันธ์ที่จำเป็นที่กำหนดมูลค่าสินทรัพย์สุทธิของกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) ที่ลงทุนในหุ้นกลุ่มสถาบันการเงิน ด้วยวิธีกำลังสองน้อยที่สุดครั้งที่ 2

Dependent Variable: R1SMARTLTF

Method: Least Squares

Date: 05/16/11 Time: 13:41

Sample (adjusted): 1/02/2010 12/30/2010

Included observations: 363 after adjustments

Convergence achieved after 7 iterations

Variable	Coefficient	Std. Error	t Statistic	Prob.
C	-0.090747	0.197052	-0.460524	0.6454
RF	5.653806	0.043992	128.5178	0.0000
RP	0.000452	9.400005	4.804884	0.0000
AR (1)	0.794038	0.032400	24.50698	0.0000
R squared	0.978253	Mean dependent var		6.965332
Adjusted R squared	0.978071	SD dependent var		4.932248
SE of regression	0.730389	Akaike info criterion		2.220480
Sum squared resid	191.5152	Schwarz criterion		2.263394
Log likelihood	-399.0172	F statistic		5382.937
Durbin-Watson stat	1.798492	Prob (F statistic)		0.000000
Inverted AR Roots	.79			

ที่มา. จากการคำนวณ

ตาราง 17

ผลการทดสอบความสัมพันธ์ปัจจัยที่กำหนดมูลค่าสินทรัพย์สุทธิของกองทุนรวมหุ้น-
ระยะยาว (LTF) ที่ลงทุนในหุ้นกลุ่มสถาบันการเงิน ด้วยวิธีกำลังสองน้อยที่สุด

Dependent Variable: RASPGTTF

Method: Least Squares

Date: 05/16/11 Time: 13:01

Sample: 1/01/2010 12/30/2010

Included observations: 364

Variable	Coefficient	Std. Error	t Statistic	Prob.
C	-0.308339	0.103722	-2.972739	0.0031
RF	0.241846	0.178786	1.352707	0.1770
RP	0.016969	0.000397	42.76878	0.0000
R squared	0.982732	Mean dependent var		14.36624
Adjusted R squared	0.982636	SD dependent var		2.400687
SE of regression	0.316346	Akaike info criterion		0.544244
Sum squared resid	36.12689	Schwarz criterion		0.576364
Log likelihood	-96.05244	F statistic		10272.10
Durbin-Watson stat	0.219955	Prob (F statistic)		0.000000

ที่มา. จากการคำนวณ

ตาราง 18

ผลการทดสอบความสัมพันธ์ปัจจัยที่กำหนดมูลค่าสินทรัพย์สุทธิของกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) ที่ลงทุนในหุ้นกลุ่มสถาบันการเงิน ด้วยวิธีกำลังสองน้อยที่สุดครั้งที่ 2

Dependent Variable: RASPGTTF

Method: Least Squares

Date: 05/16/11 Time: 13:03

Sample (adjusted): 1/02/2010 12/30/2010

Included observations: 363 after adjustments

Convergence achieved after 7 iterations

Variable	Coefficient	Std. Error	t Statistic	Prob.
C	-0.054745	0.228499	-0.239586	0.8108
RF	3.377246	0.379498	8.899255	0.0000
RP	0.009971	0.000788	12.65714	0.0000
AR (1)	0.954634	0.016465	57.98085	0.0000

R squared	0.996729	Mean dependent var	14.40582
Adjusted R squared	0.996702	SD dependent var	2.281997
SE of regression	0.131048	Akaike info criterion	-1.215546
Sum squared resid	6.165326	Schwarz criterion	-1.172633
Log likelihood	224.6216	F statistic	36469.79
Durbin-Watson stat	1.883217	Prob (F statistic)	0.000000
Inverted AR Roots	.95		

ที่มา. จากการคำนวณ



ตาราง 19

ผลการทดสอบความสัมพันธ์ปัจจัยที่กำหนดมูลค่าสินทรัพย์สุทธิของกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) ที่ลงทุนในหุ้นกลุ่มสถาบันการเงิน ด้วยวิธีกำลังสองน้อยที่สุด

Dependent Variable: RBLT75

Method: Least Squares

Date: 05/16/11 Time: 13:04

Sample: 1/01/2010 12/30/2010

Included observations: 364

Variable	Coefficient	Std. Error	t Statistic	Prob.
C	2.209455	0.089633	24.64994	0.0000
RF	0.334490	0.154501	2.164970	0.0310
RP	0.013198	0.000343	38.49298	0.0000
R squared	0.974955	Mean dependent var		12.69034
Adjusted R squared	0.974816	SD dependent var		1.722658
SE of regression	0.273375	Akaike info criterion		0.252265
Sum squared resid	26.97898	Schwarz criterion		0.284384
Log likelihood	-42.91220	F statistic		7026.530
Durbin-Watson stat	0.211451	Prob (F statistic)		0.000000

ที่มา. จากการคำนวณ

ตาราง 20

ผลการทดสอบความสัมพันธ์ปัจจัยที่กำหนดมูลค่าสินทรัพย์สุทธิของกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) ที่ลงทุนในหุ้นกลุ่มสถาบันการเงิน ด้วยวิธีกำลังสองน้อยที่สุดครั้งที่ 2

Dependent Variable: RBLT75

Method: Least Squares

Date: 05/16/11 Time: 13:05

Sample (adjusted): 1/02/2010 12/30/2010

Included observations: 363 after adjustments

Convergence achieved after 7 iterations

Variable	Coefficient	Std. Error	t Statistic	Prob.
C	0.418789	0.648897	0.645386	0.5191
RF	1.455726	0.110970	13.11816	0.0000
RP	0.012523	0.000230	54.49584	0.0000
AR (1)	1.005958	0.003935	255.6640	0.0000

R squared	0.999398	Mean dependent var	12.72529
Adjusted R squared	0.999393	SD dependent var	1.590487
SE of regression	0.039173	Akaike info criterion	-3.630722
Sum squared resid	0.550882	Schwarz criterion	-3.587809
Log likelihood	662.9761	F statistic	198802.6
Durbin-Watson stat	1.908102	Prob (F statistic)	0.000000
Inverted AR Roots	.98		

ที่มา. จากการคำนวณ

ตาราง 21

ผลการทดสอบความสัมพันธ์ปัจจัยที่กำหนดมูลค่าสินทรัพย์สุทธิของกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) ที่ลงทุนในหุ้นกลุ่มสถาบันการเงิน ด้วยวิธีกำลังสองน้อยที่สุด

Dependent Variable: RMSCORELTF

Method: Least Squares

Date: 05/16/11 Time: 13:07

Sample: 1/01/2010 12/30/2010

Included observations: 364

Variable	Coefficient	Std. Error	<i>t</i> Statistic	Prob.
C	-0.580735	0.108198	-5.367339	0.0000
RF	0.095578	0.186501	0.512481	0.6086
RP	0.016377	0.000414	39.56791	0.0000

<i>R</i> squared	0.979184	Mean dependent var	13.33545
Adjusted <i>R</i> squared	0.979069	<i>SD</i> dependent var	2.280917
<i>SE</i> of regression	0.329996	Akaike info criterion	0.628734
Sum squared resid	39.31191	Schwarz criterion	0.660854
Log likelihood	-111.4296	<i>F</i> statistic	8490.693
Durbin-Watson stat	0.339839	Prob (<i>F</i> statistic)	0.000000

ที่มา. จากการคำนวณ

ตาราง 22

ผลการทดสอบความสัมพันธ์ปัจจัยที่กำหนดมูลค่าสินทรัพย์สุทธิของกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) ที่ลงทุนในหุ้นกลุ่มสถาบันการเงิน ด้วยวิธีกำลังสองน้อยที่สุดครั้งที่ 2

Dependent Variable: RMSCORELTF

Method: Least Squares

Date: 05/16/11 Time: 13:08

Sample (adjusted): 1/02/2010 12/30/2010

Included observations: 363 after adjustments

Convergence achieved after 7 iterations

Variable	Coefficient	Std. Error	t Statistic	Prob.
C	0.079793	0.277980	0.287045	0.7742
RF	4.430907	0.475244	9.323446	0.0000
RP	0.006380	0.000987	6.462457	0.0000
AR (1)	0.952210	0.016762	56.80696	0.0000
R squared	0.994388	Mean dependent var		13.37219
Adjusted R squared	0.994341	SD dependent var		2.173557
SE of regression	0.163512	Akaike info criterion		-0.772906
Sum squared resid	9.598251	Schwarz criterion		-0.729993
Log likelihood	144.2825	F statistic		21202.51
Durbin-Watson stat	1.892693	Prob (F statistic)		0.000000
Inverted AR Roots	.95			

ที่มา. จากการคำนวณ

ตาราง 23

ผลการทดสอบความสัมพันธ์ปัจจัยที่กำหนดมูลค่าสินทรัพย์สุทธิของกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) ที่ลงทุนในหุ้นกลุ่มสถาบันการเงิน ด้วยวิธีกำลังสองน้อยที่สุด

Dependent Variable: RPLTF

Method: Least Squares

Date: 05/16/11 Time: 13:09

Sample: 1/01/2010 12/30/2010

Included observations: 364

Variable	Coefficient	Std. Error	<i>t</i> Statistic	Prob.
C	0.975330	0.082923	11.76194	0.0000
RF	0.209912	0.142934	1.468592	0.1428
RP	0.010455	0.000317	32.96045	0.0000
<i>R</i> squared	0.971922	Mean dependent var		10.12536
Adjusted <i>R</i> squared	0.971766	<i>SD</i> dependent var		1.505146
<i>SE</i> of regression	0.252908	Akaike info criterion		0.096626
Sum squared resid	23.09046	Schwarz criterion		0.128746
Log likelihood	-14.58598	<i>F</i> statistic		6247.979
Durbin-Watson stat	0.245524	Prob (<i>F</i> statistic)		0.000000

ที่มา. จากการคำนวณ

ตาราง 24

ผลการทดสอบความสัมพันธ์ปัจจัยที่กำหนดมูลค่าสินทรัพย์สุทธิของกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) ที่ลงทุนในหุ้นกลุ่มสถาบันการเงิน ด้วยวิธีกำลังสองน้อยที่สุดครั้งที่ 2

Dependent Variable: RPLTF

Method: Least Squares

Date: 05/16/11 Time: 13:09

Sample (adjusted): 1/02/2010 12/30/2010

Included observations: 363 after adjustments

Convergence achieved after 8 iterations

Variable	Coefficient	Std. Error	t Statistic	Prob.
C	-0.416235	0.401590	-1.036466	0.3007
RF	3.518760	0.293040	12.00778	0.0000
RP	0.004800	0.000606	7.916181	0.0000
AR (1)	0.983619	0.012536	78.46598	0.0000
R squared	0.994900	Mean dependent var		10.15326
Adjusted R squared	0.994858	SD dependent var		1.409868
SE of regression	0.101103	Akaike info criterion		-1.734392
Sum squared resid	3.669645	Schwarz criterion		-1.691479
Log likelihood	318.7922	F statistic		23345.02
Durbin-Watson stat	1.856188	Prob (F statistic)		0.000000
Inverted AR Roots	.98			

ที่มา. จากการคำนวณ

ตาราง 25

ผลการทดสอบความสัมพันธ์ปัจจัยที่กำหนดมูลค่าสินทรัพย์สุทธิของกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) ที่ลงทุนในหุ้นกลุ่มสถาบันการเงิน ด้วยวิธีกำลังสองน้อยที่สุด

Dependent Variable: RSCBLT3

Method: Least Squares

Date: 05/16/11 Time: 13:12

Sample: 1/01/2010 12/30/2010

Included observations: 364

Variable	Coefficient	Std. Error	<i>t</i> Statistic	Prob.
C	-1.384954	0.110427	-12.54179	0.0000
RF	0.212579	0.190344	1.116819	0.2648
RP	0.019751	0.000422	46.75847	0.0000

<i>R</i> squared	0.983929	Mean dependent var	14.81393
Adjusted <i>R</i> squared	0.983840	<i>SD</i> dependent var	2.649345
<i>SE</i> of regression	0.336795	Akaike info criterion	0.669523
Sum squared resid	40.94853	Schwarz criterion	0.701642
Log likelihood	-118.8531	<i>F</i> statistic	11050.60
Durbin-Watson stat	0.270025	Prob (<i>F</i> statistic)	0.000000

ที่มา. จากการคำนวณ

ตาราง 26

ผลการทดสอบความสัมพันธ์ปัจจัยที่กำหนดมูลค่าสินทรัพย์สุทธิของกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) ที่ลงทุนในหุ้นกลุ่มสถาบันการเงิน ด้วยวิธีกำลังสองน้อยที่สุดครั้งที่ 2

Dependent Variable: RSCBLT3

Method: Least Squares

Date: 05/16/11 Time: 13:13

Sample (adjusted): 1/02/2010 12/30/2010

Included observations: 363 after adjustments

Convergence achieved after 7 iterations

Variable	Coefficient	Std. Error	t Statistic	Prob.
C	0.677315	0.279377	2.424381	0.0158
RF	2.535961	0.368050	6.890264	0.0000
RP	0.011520	0.000763	15.10205	0.0000
AR (1)	0.969139	0.012749	76.01690	0.0000

R squared	0.997443	Mean dependent var	14.85474
Adjusted R squared	0.997422	SD dependent var	2.535848
SE of regression	0.128752	Akaike info criterion	-1.250899
Sum squared resid	5.951173	Schwarz criterion	-1.207985
Log likelihood	231.0381	F statistic	46688.92
Durbin-Watson stat	2.196257	Prob (F statistic)	0.000000
Inverted AR Roots	.97		

ที่มา. จากการคำนวณ

ตาราง 27

ผลการทดสอบความสัมพันธ์ปัจจัยที่กำหนดมูลค่าสินทรัพย์สุทธิของกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) ที่ลงทุนในหุ้นกลุ่มสถาบันการเงิน ด้วยวิธีกำลังสองน้อยที่สุด

Dependent Variable: RSCBLTS

Method: Least Squares

Date: 05/16/11 Time: 13:14

Sample: 1/01/2010 12/30/2010

Included observations: 364

Variable	Coefficient	Std. Error	<i>t</i> Statistic	Prob.
C	4.543023	0.165809	27.39912	0.0000
RF	0.107917	0.285806	0.377590	0.7060
RP	0.006778	0.000634	10.68643	0.0000

<i>R</i> squared	0.757701	Mean dependent var	10.03954
Adjusted <i>R</i> squared	0.756359	<i>SD</i> dependent var	1.024525
<i>SE</i> of regression	0.505706	Akaike info criterion	1.482485
Sum squared resid	92.32163	Schwarz criterion	1.514605
Log likelihood	-266.8123	<i>F</i> statistic	564.4474
Durbin-Watson stat	0.255373	Prob (<i>F</i> statistic)	0.000000

ที่มา. จากการคำนวณ

ตาราง 28

ผลการทดสอบความสัมพันธ์ปัจจัยที่กำหนดมูลค่าสินทรัพย์สุทธิของกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) ที่ลงทุนในหุ้นกลุ่มสถาบันการเงิน ด้วยวิธีกำลังสองน้อยที่สุดครั้งที่ 2

Dependent Variable: RSCBLTS

Method: Least Squares

Date: 05/16/11 Time: 13:14

Sample (adjusted): 1/02/2010 12/30/2010

Included observations: 363 after adjustments

Convergence achieved after 7 iterations

Variable	Coefficient	Std. Error	t Statistic	Prob.
C	1.315265	1.604342	0.819816	0.4129
RF	2.963568	0.139475	21.24797	0.0000
RP	0.006827	0.000289	23.64561	0.0000
AR (1)	1.003855	0.002457	408.6374	0.0000

R squared	0.996886	Mean dependent var	10.06719
Adjusted R squared	0.996860	SD dependent var	0.879405
SE of regression	0.049280	Akaike info criterion	-3.171658
Sum squared resid	0.871821	Schwarz criterion	-3.128744
Log likelihood	579.6559	F statistic	38306.92
Durbin-Watson stat	1.826882	Prob (F statistic)	0.000000
Inverted AR Roots	.98		

ที่มา. จากการคำนวณ

บรรณานุกรม

- กฤษฎา มาสมบุญ. (2550). *ประสิทธิภาพการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ และกองทุนรวมหุ้นระยะยาว*. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต, มหาวิทยาลัยรามคำแหง.
- ขวัญฤดี บุญกนิษฐ. (2549). *ปัจจัยที่มีผลกระทบต่ออัตราผลตอบแทนของการลงทุนในกองทุนรวมหุ้นระยะยาว*. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต, มหาวิทยาลัยขอนแก่น.
- จักรณัฏเทพ กรินชัย. (2544). *การเปรียบเทียบความเสี่ยง อัตราผลตอบแทนและผลการดำเนินงานของกองทุนรวมในประเทศไทยจำแนกตามนโยบายการลงทุน*. วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต, มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์.
- เจษฎา สุขทิศ. (2553). *เทคนิคเลือกซื้อกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF)*. ค้นเมื่อ 5 ตุลาคม 2553, จาก <http://fundmanagertalk.com/fundtalk-ltf-selecting-technique/>
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. (2553ก). *การดำเนินการสิทธิประโยชน์ทางภาษี*. ค้นเมื่อ 5 ตุลาคม 2553, จาก <http://www.sec.or.th/infocenter/report/>
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. (2553ข). *การเดินทางแห่งชีวิต ร้อยเรียงเรื่องเล่า 30 ปี*. ค้นเมื่อ 13 สิงหาคม 2553, จาก http://www.set.or.th/th/about/overview/book30years_p1.htmthailand.org/index.php?option=com_content&task=view&id=880&Itemid=460
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. (2553ค). *การลงทุนเฉลี่ยต้นทุน*. ค้นเมื่อ 5 ตุลาคม 2553, จาก <http://www.set.or.th/ltf/benefit/why.html>
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. (2553ง). *ดัชนีตลาดหลักทรัพย์*. ค้นเมื่อ 5 ตุลาคม 2553, จาก http://www.set.or.th/th/market/market_statistics.html#monthly
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. (2553จ). *สัดส่วนการลงทุนกองทุนหุ้นระยะยาว แบ่งตามกลุ่มอุตสาหกรรม*. ค้นเมื่อ 24 สิงหาคม 2553, จาก http://www.sec.or.th/infocenter/report/Content_0000000138.jsp?categoryID=CAT000569&lang=th

- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย, สถาบันพัฒนาความรู้ตลาดทุน. (2548ก). *ตลาดการเงินและการลงทุนในหลักทรัพย์*. กรุงเทพมหานคร: ผู้แต่ง.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย, สถาบันพัฒนาความรู้ตลาดทุน. (2548ข). *ทฤษฎีตลาดทุน*. กรุงเทพมหานคร: ผู้แต่ง.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย, สถาบันพัฒนาความรู้ตลาดทุน. (2553). *ประเภทผู้ลงทุน*. ค้นเมื่อ 24 สิงหาคม 2553, จาก http://www.tsi-thailand.org/index.php?option=com_content&task=view&id=96&Itemid=70
- ทรงพล ไส้ไหม. (2546). *การวิเคราะห์อัตราผลตอบแทน ความเสี่ยงและประสิทธิภาพการบริหารของกองทุนรวมผสมแบบยืดหยุ่นของประเทศไทย*. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต, มหาวิทยาลัยรามคำแหง.
- ประภพ ปฏิภาณวิเศษ. (2550). *ผลตอบแทนและความเสี่ยงของกองทุนรวมหุ้นระยะยาว*. งานวิจัยเฉพาะเรื่องเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต, มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- มหาวิทยาลัยขอนแก่น, คณะนิติศาสตร์. (ม.ป.ป.). *กฎหมายการเงิน*. ค้นเมื่อ 6 เมษายน 2554, จาก http://kittibodee.blogspot.com/2009/02/blog-post_8096.html
- มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี. (2544). *การลงทุน*. กรุงเทพมหานคร: ผู้แต่ง.
- ศิริพร พรไชยะ. (2543). *การประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวมในประเทศไทย กรณีศึกษา: กองทุนรวมตราสารทุน 2539-2542*. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต, มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย. (2553). *มูลค่าอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล*. ค้นเมื่อ 5 ตุลาคม 2553, จาก http://www.thaibma.or.th/bond_info.html
- สมาคมบริษัทจัดการลงทุน. (2553ก). *กองทุนรวมหุ้นระยะยาว LTF และบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน*. ค้นเมื่อ 13 สิงหาคม 2553, จาก <http://www.aimc.or.th>
- สมาคมบริษัทจัดการลงทุน. (2553ข). *เปิดประตูสู่การลงทุน*. ค้นเมื่อ 24 สิงหาคม 2553, จาก http://www.aimc.or.th/40_knowledge_index.php

- สมาคมบริษัทจัดการลงทุน. (2553ค). มูลค่าทรัพย์สินกองทุนรวม *RMF* และกองทุน *LTF*. ค้นเมื่อ 13 สิงหาคม 2553, จาก http://www.aimc.or.th/21_overview_detail.php?nid=36&subid=0&ntype=2
- สมาคมบริษัทจัดการลงทุน. (2553ง). มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ. ค้นเมื่อ 5 ตุลาคม 2553, จาก http://www.thaimutualfund.com/AIMC/aimc_navCenter.jsp
- สมาคมบริษัทจัดการลงทุน. (2553จ). มูลค่าทรัพย์สินสุทธิแยกตามประเภทกองทุน ลักษณะพิเศษที่สำคัญปี 2545-2553 ครึ่งปี. ค้นเมื่อ 5 ตุลาคม 2553, จาก http://www.aimc.or.th/21_overview_detail.php?nid=14&subid=0&ntype=2
- สมาคมบริษัทจัดการลงทุน. (2553ฉ). สถิติการเจริญเติบโตของกองทุนรวมที่เป็นกองทุนระยะยาว ปี พ.ศ. 2547-2552. ค้นเมื่อ 5 ตุลาคม 2553, จาก http://www.aimc.or.th/21_infostats_rmfltffif.php
- Markowitz, H. M. (1952). Portfolio selection. *The Journal of Finance*, 7(1), 77-91.
- Treynor, J. L., & Mazuy, K. K. (1966). Can mutual funds outguess the market. *Harvard Business Review*, 44, 131-136.



ประวัติผู้เขียน

ชื่อ ชื่อสกุล	นางสาวนิภาภรณ์ ว่องไว
วัน เดือน ปีเกิด	25 พฤษภาคม 2529
สถานที่เกิด	กรุงเทพมหานคร
วุฒิการศึกษา	สำเร็จการศึกษาระดับมัธยมศึกษาตอนปลาย จากโรงเรียนศึกษานารีวิทยา ปีการศึกษา 2546 สำเร็จปริญญาตรีบริหารธุรกิจบัณฑิต จากมหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์ ปีการศึกษา 2550
ตำแหน่งหน้าที่ การงานปัจจุบัน	เจ้าหน้าที่ฝ่ายพัฒนาช่องทางการขาย บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนธนาชาติ

