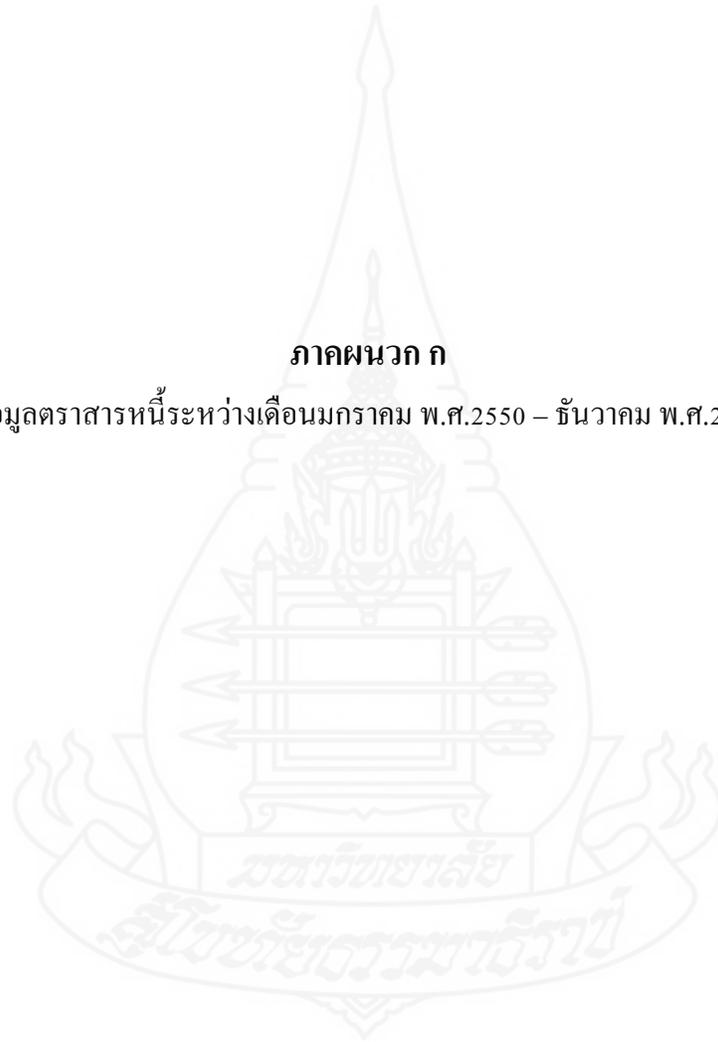


ภาคผนวก



ภาคผนวก ก

ข้อมูลตราสารหนี้ระหว่างเดือนมกราคม พ.ศ.2550 – ธันวาคม พ.ศ.2554



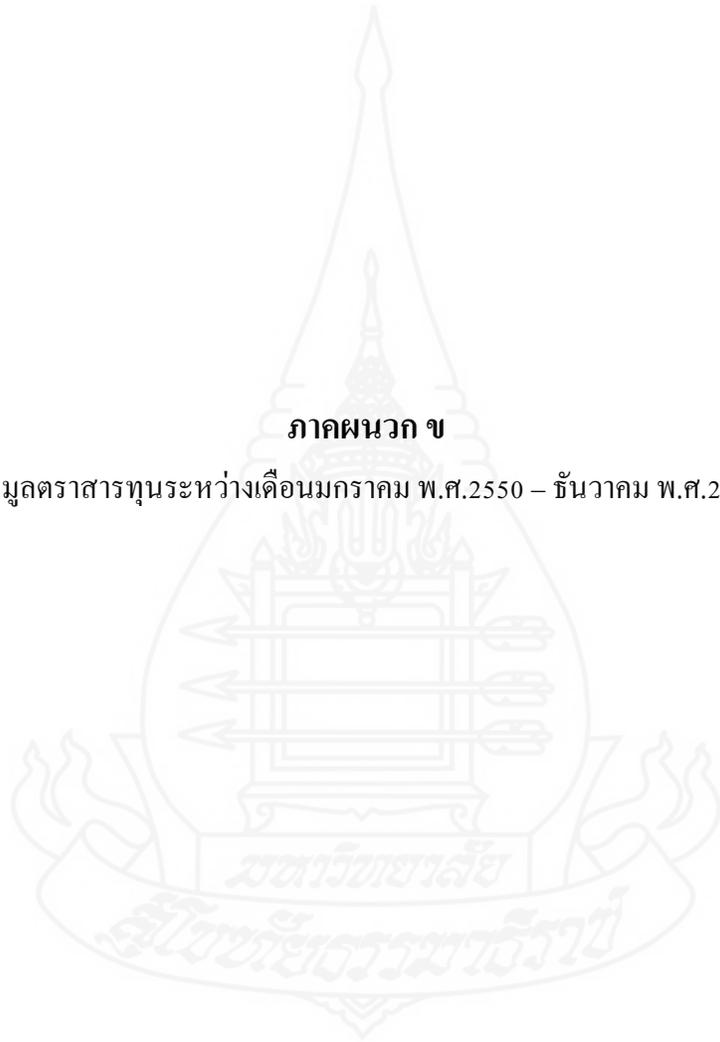
ข้อมูลตราสารหนี้ระหว่างเดือนมกราคม พ.ศ.2550 – ธันวาคม พ.ศ.2554

Month/Year	Rp-Bond	Sp-Bond	Bp-Bond	Rm-Bond	Sm-Bond	Rf-Bond18	Rm-Bond	TI-Bond	Rm-Rf	SI-Bond	S-Bond	JI-Bond
Jan-07	4.75879266	0.117098059	59	0.079313211	0.016826515	5.43	2.52007123	0.079123604	0.079032769	39.86652468	4.69691844	5.32831321
Feb-07	4.5744506	0.061651302	59	0.076240843	0.320403755	4.9	2.52007123	0.07614888	0.070900781	72.87411267	0.22128574	4.81290754
Mar-07	4.16747326	0.162511644	59	0.069457888	0.320579642	4.58	2.52007123	0.069341355	0.064114894	25.17444183	0.19999677	4.49679118
Apr-07	3.69916689	0.138280896	59	0.061652781	0.323327572	4.49	2.52007123	0.061429382	0.056263989	26.20993687	0.17401544	4.40198612
May-07	3.28453357	0.173534275	59	0.054742226	0.326140543	4.28	2.52007123	0.054461021	0.04930655	18.51622819	0.15118191	4.19207555
Jun-07	2.99917616	0.078366703	59	0.049986269	0.329019169	4.9	2.52007123	0.049449313	0.044502617	37.22894269	0.13525843	4.78665298
Jul-07	3.13959188	0.039783428	59	0.052326531	0.331967424	4.94	2.52007123	0.051817942	0.046793741	76.84753941	0.14095883	4.82765987
Aug-07	3.11897235	0.01050616	59	0.051982872	0.335000588	5.05	2.52007123	0.051437384	0.046399529	288.8596482	0.13850581	4.93364959
Sep-07	3.12259559	0.019971537	59	0.05204326	0.338117838	5.05	2.52007123	0.051498795	0.046407962	152.137961	0.13725381	4.93370993
Oct-07	3.2028382	0.022702662	59	0.053380637	0.341323881	5.18	2.52007123	0.052822116	0.047691905	137.2748654	0.13972625	5.06071393
Nov-07	3.27531169	0.020185769	59	0.054588528	0.344625386	5.42	2.52007123	0.053982684	0.048844772	157.7833549	0.14173295	5.29392185
Dec-07	3.30088655	0.006366593	59	0.055014776	0.348026819	5.55	2.52007123	0.054379433	0.049214329	503.9408919	0.14140959	5.42001477
Jan-08	3.17886039	0.087728312	59	0.052981007	0.351531799	5.08	2.52007123	0.052443961	0.047122143	35.27018419	0.13404802	4.96364766
Feb-08	3.02314286	0.03223527	59	0.050385714	0.355140899	4.81	2.52007123	0.049880952	0.044466699	91.29677493	0.12520861	4.70005242
Mar-08	2.9282483	0.024512094	59	0.048804138	0.358857918	5.04	2.52007123	0.048207598	0.042823173	116.0344889	0.11933183	4.92080416
Apr-08	3.02625877	0.05032954	59	0.050437646	0.36269044	5.19	2.52007123	0.04982642	0.044392806	58.41020546	0.12239861	5.06743766
May-08	3.22190163	0.04503701	59	0.05369836	0.366652428	5.44	2.52007123	0.053071779	0.047587487	69.52581803	0.12978909	5.31236508
Jun-08	3.46131293	0.093834865	59	0.057688549	0.370754875	6.17	2.52007123	0.056923383	0.051509301	35.791383	0.13893088	6.02202185
Jul-08	3.57096088	0.031422056	59	0.059516015	0.37500702	6.11	2.52007123	0.058798772	0.053265898	110.404219	0.14203973	5.96584931
Aug-08	3.6157	0.092129428	59	0.060261667	0.379412764	5.49	2.52007123	0.059732203	0.053938121	38.25270683	0.14216211	5.36726165
Sep-08	3.77981548	0.008938081	59	0.062996925	0.383979113	5.02	2.52007123	0.06264659	0.056597273	413.5282293	0.14739675	4.91566359
Oct-08	3.51166937	0.063506528	59	0.058527823	0.388720043	4.84	2.52007123	0.058152588	0.052049155	54.02598462	0.13389882	4.7371945
Nov-08	3.2553125	0.070374122	59	0.054255208	0.393631295	4.52	2.52007123	0.053897952	0.047694687	45.18676861	0.12116589	4.42358854
Dec-08	2.35658036	0.336394458	59	0.039276339	0.398722586	3.46	2.52007123	0.038964639	0.032630963	6.833982057	0.08183876	3.38394304
Jan-09	1.90487202	0.060730176	59	0.031747867	0.403966724	4.13	2.52007123	0.0311193	0.025015088	30.23272468	0.06192364	4.02408119
Feb-09	1.52933271	0.089984889	59	0.025488878	0.409391228	4.61	2.52007123	0.024618633	0.018665691	16.14159211	0.04559377	4.48182222
Mar-09	1.18487933	0.075104633	59	0.019747989	0.415009292	4.87	2.52007123	0.018706994	0.012831167	14.6956668	0.03091778	4.72741466
Apr-09	0.95257275	0.092330695	59	0.015876213	0.420832918	4.39	2.52007123	0.014905188	0.008862331	9.524525771	0.02105902	4.25954287
May-09	1.0808373	0.019939759	59	0.018013955	0.426884544	4.56	2.52007123	0.017031141	0.010899213	50.3936533	0.02553199	4.42601396
Jun-09	1.21454004	0.051334595	59	0.020242334	0.433218788	4.74	2.52007123	0.019246441	0.013022021	22.12036626	0.03005876	4.60224234
Jul-09	1.2239119	0.00894612	59	0.020398532	0.439858394	4.55	2.52007123	0.019458959	0.013067559	128.3325701	0.02970856	4.41873183
Aug-09	1.21708333	0.015008899	59	0.020284722	0.446813807	4.51	2.52007123	0.01935452	0.012837825	76.08264044	0.02873194	4.37995142
Sep-09	1.29908415	0.032040419	59	0.021651402	0.454108868	4.54	2.52007123	0.020735889	0.014082921	38.18356676	0.03101221	4.41031811
Oct-09	1.32327268	0.014350889	59	0.022054545	0.461783513	4.71	2.52007123	0.021097842	0.014358153	86.73836694	0.03109282	4.57505452
Nov-09	1.35317007	0.025389623	59	0.022552834	0.469863829	4.77	2.52007123	0.021587628	0.014721771	50.16498544	0.03133199	4.63355286

Month/Year	Rp-Bond	Sp-Bond	Bp-Bond	Rm-Bond	Sm-Bond	Rf-Bond18	Rm-Bond	TI-Bond	Rm-Rf	SI-Bond	S-Bond	Jl-Bond
Dec-09	1.29807321	0.03037292	59	0.021634554	0.478387581	4.76	2.52007123	0.020656608	0.013661427	40.12587137	0.02855724	4.62296784
Jan-10	1.25915298	0.041290304	59	0.020985883	0.487384061	4.59	2.52007123	0.020044966	0.012862815	28.64238965	0.02639154	4.45798588
Feb-10	1.35937976	0.008602312	59	0.022656329	0.496901208	4.34	2.52007123	0.021814346	0.014374643	149.6163391	0.02892857	4.21798967
Mar-10	1.36823918	0.004711073	59	0.022803986	0.507014948	4.28	2.52007123	0.021981455	0.014353737	275.288845	0.02831028	4.16013732
Apr-10	1.32405523	0.028522559	59	0.022067587	0.517773395	4.14	2.52007123	0.021272122	0.013438031	44.00219577	0.0259535	4.02406759
May-10	1.3143311	0.015013156	59	0.021905518	0.529237718	3.99	2.52007123	0.02114968	0.01308489	83.11584193	0.02472403	3.87890554
Jun-10	1.28649459	0.013008195	59	0.021441576	0.541495778	3.8	2.52007123	0.020731547	0.012416647	94.03005229	0.02293027	3.69477492
Jul-10	1.52670208	0.111124166	59	0.025445035	0.554639369	3.82	2.52007123	0.02479721	0.016201045	13.16577184	0.02921005	3.7181117
Aug-10	1.70813033	0.033232915	59	0.028468839	0.568845217	3.74	2.52007123	0.027894864	0.018988085	49.52310061	0.03338006	3.64380214
Sep-10	1.76587662	0.004446248	59	0.029431277	0.584246524	3.54	2.52007123	0.028930112	0.019693835	383.891457	0.03370809	3.45143128
Oct-10	1.77519524	0.007125132	59	0.029586587	0.600984866	3.47	2.52007123	0.029107829	0.019570173	241.0287844	0.0325635	3.38391992
Nov-10	1.82898593	0.017400433	59	0.030483099	0.619250299	3.79	2.52007123	0.02992914	0.020162261	101.4813404	0.03255915	3.69414978
Dec-10	2.06095357	0.059164194	59	0.034349226	0.639304523	4.08	2.52007123	0.033778874	0.023694151	33.68513008	0.03706239	3.97834924
Jan-11	2.18809226	0.039674824	59	0.036468204	0.661524447	4.17	2.52007123	0.035908343	0.025442797	53.39890763	0.03846086	4.06746823
Feb-11	2.2963208	0.045905257	59	0.038272013	0.686283377	4.22	2.52007123	0.037728601	0.026833957	48.49090528	0.0391004	4.11760535
Mar-11	2.48160404	0.045236607	59	0.041360067	0.714093862	4.19	2.52007123	0.04087747	0.029458503	53.31458003	0.04125298	4.0916934
Apr-11	2.63672689	0.040527628	59	0.043945448	0.745676605	4.13	2.52007123	0.04352362	0.031517505	63.36155568	0.04226699	4.03627877
May-11	2.77440146	0.029868421	59	0.046240024	0.781946921	4.1	2.52007123	0.045865561	0.033207576	90.59963772	0.04246781	4.00957335
Jun-11	3.02855817	0.102737836	59	0.05047597	0.824175996	3.99	2.52007123	0.050204376	0.036739703	28.83122992	0.0445775	3.90747594
Jul-11	3.28568609	0.080656044	59	0.054761435	0.874291055	4.13	2.52007123	0.054522928	0.040189917	39.88359207	0.04596858	4.04709474
Aug-11	3.36384632	0.030991787	59	0.056064105	0.935093657	3.91	2.52007123	0.055909825	0.040479211	106.4372201	0.04328894	3.83573081
Sep-11	3.47584253	0.032188376	59	0.057930709	1.010780971	3.91	2.52007123	0.057808066	0.041084359	105.9598616	0.04064615	3.83759739
Oct-11	3.45471131	0.047012928	59	0.057578522	1.108712119	3.87	2.52007123	0.057461209	0.039099987	72.11232004	0.03526613	3.79857851
Nov-11	3.33247531	0.038461633	59	0.055541255	1.242231485	3.75	2.52007123	0.05542331	0.034837397	85.019149	0.02804421	3.68054126
Dec-11	3.15332974	0.034586628	59	0.052555496	1.439947822	3.73	2.52007123	0.052392594	0.028556365	89.3745141	0.01983153	3.65822216

ภาคผนวก ข

ข้อมูลตราสารทุนระหว่างเดือนมกราคม พ.ศ.2550 – ธันวาคม พ.ศ.2554



ข้อมูลตราสารทุนระหว่างเดือนมกราคม พ.ศ.2550 – ธันวาคม พ.ศ.2554

Month/Year	Rp-Equity	Sp-Equity	Bp-Equity	Rm-Equity	Sm-Equity	Rf-Bond18	Rm-Equity	Tl-Equity	Rm-Rf	Sl-Equity	S-Equity	Jl-Equity
Jan-07	4.57	0.855599205	59	0.076167	0.017676182	5.43	4.0316667	0.075923729	0.07587206	5.235512111	4.292333133	5.325166647
Feb-07	4.54	0.834386002	59	0.075667	0.512134575	4.9	4.0316667	0.075564972	0.06713109	5.343250393	0.131080957	4.812333333
Mar-07	4.47	0.784888527	59	0.0745	0.512370195	4.58	4.0316667	0.074468927	0.0659605	5.597822513	0.128736014	4.501833314
Apr-07	4.29	0.657609307	59	0.0715	0.516712477	4.49	4.0316667	0.071443503	0.06288813	6.409834262	0.121708161	4.411833314
May-07	4.03	0.473761543	59	0.067167	0.521160926	4.28	4.0316667	0.067096045	0.05848065	8.355821036	0.112212271	4.204499961
Jun-07	3.85	0.346482323	59	0.064167	0.525716619	4.9	4.0316667	0.063870056	0.05540472	10.87597572	0.105388951	4.800833333
Jul-07	3.42	0.042426407	59	0.057	0.530386647	4.94	4.0316667	0.056570621	0.04816022	78.66955755	0.090802102	4.832333314
Aug-07	3.6	0.169705627	59	0.06	0.535164255	5.05	4.0316667	0.059590395	0.0510806	20.71724665	0.095448445	4.941666686
Sep-07	3.42	0.042426407	59	0.057	0.540081782	5.05	4.0316667	0.056539548	0.04799864	78.62634545	0.088872905	4.938666686
Oct-07	3.13	0.16263456	59	0.052167	0.545128692	5.18	4.0316667	0.051587571	0.04308119	18.71475944	0.079029391	5.059499961
Nov-07	3.38	0.014142136	59	0.056333	0.550304634	5.42	4.0316667	0.055757062	0.04716159	232.6145546	0.085700876	5.295666667
Dec-07	3.26	0.070710678	59	0.054333	0.555644313	5.55	4.0316667	0.053686441	0.04507259	44.79521466	0.081117711	5.419333353
Jan-08	3.43	0.049497475	59	0.057167	0.561135885	5.08	4.0316667	0.056700565	0.0478144	67.58593914	0.085210023	4.967833333
Feb-08	3.45	0.06363961	59	0.0575	0.566803109	4.81	4.0316667	0.057115819	0.04805328	52.9518225	0.084779495	4.707166686
Mar-08	3.68	0.22627417	59	0.061333	0.572646696	5.04	4.0316667	0.060949153	0.05178922	15.89222491	0.090438349	4.933333353
Apr-08	3.61	0.176776695	59	0.060167	0.578688064	5.19	4.0316667	0.059720339	0.05052187	19.93192598	0.087304143	5.077166647
May-08	3.61	0.176776695	59	0.060167	0.584920633	5.44	4.0316667	0.059649718	0.05041799	19.90835575	0.086196292	5.318833333
Jun-08	3.92	0.395979797	59	0.065333	0.591358988	6.17	4.0316667	0.06469774	0.05547735	9.639801565	0.09381332	6.029666667
Jul-08	4.45	0.770746391	59	0.074167	0.598033784	6.11	4.0316667	0.07369774	0.06419944	5.641501171	0.107350853	5.980499961
Aug-08	4.34	0.692964646	59	0.072333	0.60497108	5.49	4.0316667	0.072008475	0.06225048	6.130904404	0.102898277	5.379333353
Sep-08	5.04	1.187939392	59	0.084	0.612149106	5.02	4.0316667	0.08400565	0.07379751	4.172210608	0.120554803	4.936666686
Oct-08	7.19	2.708218972	59	0.119833	0.619629131	4.84	4.0316667	0.120497175	0.10950618	2.625095462	0.176728588	4.798500039
Nov-08	7.42	2.870853532	59	0.123667	0.627482794	4.52	4.0316667	0.124485876	0.11320862	2.558356456	0.180417091	4.492999961
Dec-08	6.7	2.361736649	59	0.111667	0.635649888	3.46	4.0316667	0.112581921	0.1010725	2.812478409	0.15900656	3.456333333
Jan-09	6.62	2.305168107	59	0.110333	0.644119641	4.13	4.0316667	0.111036723	0.09959801	2.841947469	0.154626563	4.102666667
Feb-09	6.26	2.050609665	59	0.104333	0.652934041	4.61	4.0316667	0.104799435	0.0934511	3.015282124	0.143124869	4.560666667
Mar-09	6.33	2.10010714	59	0.1055	0.662104259	4.87	4.0316667	0.105912429	0.09446493	2.975483114	0.142673798	4.813166686
Apr-09	5.47	1.491995308	59	0.091167	0.671675577	4.39	4.0316667	0.091471751	0.07997207	3.617191893	0.119063543	4.334833333
May-09	4.76	0.989949494	59	0.079333	0.681625958	4.56	4.0316667	0.079389831	0.0679729	4.731554517	0.099721702	4.487333353
Jun-09	4.4	0.735391052	59	0.073333	0.691982988	4.74	4.0316667	0.073237288	0.06180028	5.875785391	0.089308964	4.655333353
Jul-09	4.18	0.579827561	59	0.069667	0.702798342	4.55	4.0316667	0.069562147	0.05795336	7.078253852	0.082460867	4.467999961
Aug-09	4.02	0.466690476	59	0.067	0.714118027	4.51	4.0316667	0.066861582	0.05509803	8.452783024	0.077155359	4.426666686
Sep-09	3.67	0.219203102	59	0.061167	0.725987854	4.54	4.0316667	0.060920904	0.04906687	16.39727404	0.06758635	4.449833333
Oct-09	3.89	0.374766594	59	0.064833	0.738433832	4.71	4.0316667	0.064601695	0.0525261	10.17033018	0.071131766	4.617833353
Nov-09	3.89	0.374766594	59	0.064833	0.751567035	4.77	4.0316667	0.064584746	0.05230722	10.16766185	0.069597539	4.675833353

Month/Year	Rp-Equity	Sp-Equity	Bp-Equity	Rm-Equity	Sm-Equity	Rf-Bond18	Rm-Equity	Tl-Equity	Rm-Rf	Sl-Equity	S-Equity	Jl-Equity
Dec-09	3.52	0.113137085	59	0.058667	0.765427013	4.76	4.0316667	0.058316384	0.04590955	30.41148415	0.059979004	4.659999961
Jan-10	3.72	0.254558441	59	0.062	0.780037271	4.59	4.0316667	0.061754237	0.04899938	14.31301978	0.062816715	4.499
Feb-10	4	0.45254834	59	0.066667	0.795544274	4.34	4.0316667	0.066570621	0.0534076	8.678999169	0.067133404	4.261999961
Mar-10	3.73	0.261629509	59	0.062167	0.812053499	4.28	4.0316667	0.062011299	0.04863244	13.98415141	0.059888224	4.199499961
Apr-10	3.83	0.332340187	59	0.063833	0.829595539	4.14	4.0316667	0.063745763	0.05000674	11.31671747	0.060278459	4.065833353
May-10	3.95	0.417193001	59	0.065833	0.848342145	3.99	4.0316667	0.065822034	0.0516943	9.308641302	0.060935671	3.922833353
Jun-10	3.78	0.296984848	59	0.063	0.868440727	3.8	4.0316667	0.06299435	0.04852599	12.51466764	0.055877144	3.736333314
Jul-10	3.5	0.098994949	59	0.058333	0.890008428	3.82	4.0316667	0.058242938	0.04349986	34.71220873	0.048875784	3.751000039
Aug-10	3.28	0.056568542	59	0.054667	0.913211028	3.74	4.0316667	0.054536723	0.03944648	56.88084849	0.043195364	3.669999961
Sep-10	3.02	0.240416306	59	0.050333	0.938279276	3.54	4.0316667	0.050186441	0.03469535	12.31613633	0.036977632	3.472333353
Oct-10	2.98	0.268700577	59	0.049667	0.965467178	3.47	4.0316667	0.049528249	0.03357555	10.87517824	0.034776477	3.403999961
Nov-10	2.91	0.318198052	59	0.0485	0.995152987	3.79	4.0316667	0.048251412	0.03191412	8.946734008	0.032069558	3.712166686
Dec-10	2.81	0.38890873	59	0.046833	1.027735049	4.08	4.0316667	0.046474576	0.02970442	7.050497426	0.028902795	3.990833353
Jan-11	3.15	0.148492424	59	0.0525	1.063706922	4.17	4.0316667	0.052211864	0.03477155	20.7451661	0.032689034	4.0835
Feb-11	3.45	0.06363961	59	0.0575	1.103871916	4.22	4.0316667	0.057282486	0.03910213	53.10633844	0.03542271	4.136833314
Mar-11	3.37	0.007071068	59	0.056167	1.149089854	4.19	4.0316667	0.055935028	0.03701517	466.7140334	0.032212598	4.106499961
Apr-11	3.21	0.106066017	59	0.0535	1.200325541	4.13	4.0316667	0.053240113	0.03349457	29.6152034	0.027904575	4.045833314
May-11	3.28	0.056568542	59	0.054667	1.258999213	4.1	4.0316667	0.054435028	0.03368335	56.77478248	0.026754065	4.017999961
Jun-11	3.42	0.042426407	59	0.057	1.327264734	3.99	4.0316667	0.056838983	0.03487892	79.04275278	0.026278797	3.914
Jul-11	3.14	0.155563492	59	0.052333	1.408115486	4.13	4.0316667	0.052053672	0.02886474	19.74220704	0.020498846	4.044666667
Aug-11	3.34	0.014142136	59	0.055667	1.505530615	3.91	4.0316667	0.05550565	0.03057449	231.5656795	0.020308116	3.835333333
Sep-11	3.92	0.395979797	59	0.065333	1.626718567	3.91	4.0316667	0.065336158	0.03822136	9.734924262	0.023495986	3.845000039
Oct-11	3.49	0.091923882	59	0.058167	1.783958677	3.87	4.0316667	0.058059322	0.02843402	37.26452719	0.015938722	3.799166647
Nov-11	3.45	0.06363961	59	0.0575	1.997041911	3.75	4.0316667	0.057415254	0.02421597	53.2294274	0.012125919	3.6825
Dec-11	3.36	0.855599205	59	0.056	2.311595531	3.73	4.0316667	0.05589548	0.01747341	3.854413742	0.007559025	3.661666686

ภาคผนวก ค

ข้อมูลตราสารอนุพันธ์ระหว่างเดือนมกราคม พ.ศ.2550 – ธันวาคม พ.ศ.2554



ข้อมูลตราสารอนุพันธ์ระหว่างเดือนมกราคม พ.ศ.2550 – ธันวาคม พ.ศ.2554

Month/Year	Rp-Derivative	Sp-Der	Bp-Der	Rm-Der	Sm-Der	Rf-Bond18	Rm-Der	TI-Der	Rm-Rf	SI-Der	S-Der	JI-Der
Jan-07	0.13844024	2.009705849	59	0.00230734	0.14176972	5.43	1.127580759	0.000812546	-0.000056	0.023854357	-0.000395007	5.25130736
Feb-07	2.846170726	0.09505126	59	0.04743618	0.20142943	4.9	1.127580759	0.046856001	0.044079022	29.08434942	0.218831093	4.78410285
Mar-07	-0.128021849	2.198122999	59	-0.0021337	0.2014376	4.58	1.127580759	-0.00346365	-0.00549099	-0.09296804	-0.027259016	4.42519959
Apr-07	6.009784861	2.141961747	59	0.10016308	0.2031003	4.49	1.127580759	0.100592399	0.096778076	2.77080183	0.476503849	4.4404964
May-07	5.340588472	1.668768443	59	0.08900981	0.20470444	4.28	1.127580759	0.089309409	0.085598067	3.157571178	0.418154417	4.22634311
Jun-07	4.824947389	1.304155136	59	0.08041579	0.20640358	4.9	1.127580759	0.080394589	0.07697573	3.637052519	0.372937965	4.81708247
Jul-07	11.47977807	6.009831038	59	0.19132963	0.20818292	4.94	1.127580759	0.193177029	0.187859919	1.89646675	0.902379132	4.96666298
Aug-07	-2.761861105	4.060528597	59	-0.046031	0.20900171	5.05	1.127580759	-0.04823776	-0.04951438	-0.70090081	-0.23690897	4.83563564
Sep-07	4.446502231	1.036553999	59	0.07410837	0.21068583	5.05	1.127580759	0.073937891	0.07059694	4.208498128	0.335081571	4.95577503
Oct-07	10.72603005	5.4768507	59	0.17876717	0.21262631	5.18	1.127580759	0.180333843	0.175223396	1.942666927	0.824090863	5.18610051
Nov-07	-8.69850051	8.258366578	59	-0.144975	0.21370689	5.42	1.127580759	-0.14896329	-0.14853679	-1.06423392	-0.695049127	5.09435828
Dec-07	0.770150682	1.563019112	59	0.01283584	0.21438221	5.55	1.127580759	0.011485605	0.009262808	0.433552397	0.043206979	5.37783583
Jan-08	-11.12535207	9.974409772	59	-0.1854225	0.21653836	5.08	1.127580759	-0.19000032	-0.18903151	-1.1238779	-0.872970087	4.72524412
Feb-08	9.601723432	4.681845868	59	0.16002872	0.21643401	4.81	1.127580759	0.161382318	0.15642149	2.033718545	0.722721399	4.8096954
Mar-08	-4.837556855	5.528267138	59	-0.0806259	0.2179876	5.04	1.127580759	-0.08341622	-0.08425907	-0.89025308	-0.386531503	4.79137408
Apr-08	3.052132054	0.050585391	59	0.05086887	0.21966057	5.19	1.127580759	0.05026495	0.047207858	58.62625543	0.214912749	5.06786884
May-08	0.091104853	2.043177022	59	0.00151841	0.22207971	5.44	1.127580759	7.43E-06	-0.00218291	0.000214463	-0.009829418	5.26018511
Jun-08	-10.42780306	9.481168139	59	-0.1737967	0.22452038	6.17	1.127580759	-0.17848536	-0.17753872	-1.11068976	-0.790746586	5.79053662
Jul-08	-14.26169537	12.19213939	59	-0.2376949	0.22473718	6.11	1.127580759	-0.24344964	-0.24144054	-1.17809748	-1.074323993	5.6686384
Aug-08	4.08792156	0.782999175	59	0.06813203	0.22311707	5.49	1.127580759	0.067735959	0.064413408	5.103992044	0.288697802	5.37513203
Sep-08	-13.68473355	11.78416577	59	-0.2280789	0.22580377	5.02	1.127580759	-0.23336272	-0.23184229	-1.16838141	-1.026742315	4.62458782
Oct-08	-33.01592632	25.45338327	59	-0.5502654	0.22424407	4.84	1.127580759	-0.5609592	-0.55400284	-1.30028266	-2.470535099	4.12840127
Nov-08	-1.285494324	3.016579635	59	-0.0214249	0.20469048	4.52	1.127580759	-0.02306488	-0.02483641	-0.45111611	-0.121336436	4.34790839
Dec-08	11.48070226	6.010484542	59	0.19134504	0.20680133	3.46	1.127580759	0.193610773	0.187898349	1.900518255	0.908593539	3.5360117
Jan-09	-4.379657046	5.204483078	59	-0.0729943	0.20866519	4.13	1.127580759	-0.07539814	-0.07647204	-0.85474202	-0.366482007	3.91933902
Feb-09	-1.783101371	3.368440953	59	-0.0297184	0.21014099	4.61	1.127580759	-0.03152432	-0.03322071	-0.55216485	-0.158087698	4.42661495
Mar-09	0.918130478	1.458381594	59	0.01530217	0.21236683	4.87	1.127580759	0.014185827	0.011762727	0.57389905	0.055388721	4.72296884
Apr-09	17.00082395	9.913800019	59	0.28334707	0.21519302	4.39	1.127580759	0.286909445	0.279760515	1.707484239	1.300044546	4.52701374
May-09	15.86561033	9.11108277	59	0.26442684	0.21544357	4.56	1.127580759	0.267620514	0.260836113	1.733011403	1.210693448	4.67242683
Jun-09	8.190037227	3.68363298	59	0.13650062	0.21608715	4.74	1.127580759	0.137475207	0.132899168	2.201912425	0.615025784	4.71850065
Jul-09	4.257859133	0.903163184	59	0.07096432	0.21918679	4.55	1.127580759	0.070881793	0.067311206	4.630421029	0.307095173	4.46929763
Aug-09	3.248765155	0.18962599	59	0.05414609	0.22280777	4.51	1.127580759	0.053789805	0.050432623	16.7360945	0.226350375	4.41381277
Sep-09	11.1074869	5.746581426	59	0.18512478	0.22660664	4.54	1.127580759	0.186980004	0.181348004	1.919718771	0.80027664	4.57379145
Oct-09	-6.548585967	6.738147426	59	-0.1091431	0.22947528	4.71	1.127580759	-0.11232349	-0.11296769	-0.98351751	-0.492286965	4.44385687
Nov-09	0.341368406	1.866213967	59	0.00568947	0.23127719	4.77	1.127580759	0.004438448	0.001834854	0.140320676	0.007933569	4.6166895

Month/Year	Rp-Derivative	Sp-Der	Bp-Der	Rm-Der	Sm-Der	Rf-Bond18	Rm-Der	Tl-Der	Rm-Rf	Sl-Der	S-Der	Jl-Der
Dec-09	7.885289698	3.468143935	59	0.13142149	0.2353558	4.76	1.127580759	0.132304345	0.127498898	2.250759055	0.541728304	4.73275481
Jan-10	-6.490617141	6.697157276	59	-0.108177	0.23969158	4.59	1.127580759	-0.11130707	-0.11217181	-0.98058279	-0.467983941	4.32882303
Feb-10	2.801282714	0.126791878	59	0.04668805	0.24187641	4.34	1.127580759	0.046253379	0.042656772	21.52306145	0.176357718	4.24202137
Mar-10	11.15739902	5.781874627	59	0.18595665	0.24700609	4.28	1.127580759	0.187899418	0.181839882	1.91738258	0.73617569	4.32328998
Apr-10	-3.554034726	4.620679936	59	-0.0592339	0.2514195	4.14	1.127580759	-0.06140737	-0.06342424	-0.78409125	-0.252264591	3.94276608
May-10	-2.800825981	4.088080925	59	-0.0466804	0.25568478	3.99	1.127580759	-0.04859875	-0.05094185	-0.7013868	-0.199236912	3.81031957
Jun-10	4.764571826	1.261463166	59	0.07940953	0.26046176	3.8	1.127580759	0.079682008	0.075068501	3.726813925	0.288213141	3.75274287
Jul-10	6.033735828	2.158897639	59	0.10056226	0.26722676	3.82	1.127580759	0.101187613	0.096108484	2.765332202	0.35965142	3.79322894
Aug-10	7.759310129	3.379062928	59	0.12932184	0.27451737	3.74	1.127580759	0.130457234	0.124746546	2.27784358	0.454421323	3.74465518
Sep-10	8.726867911	4.063229597	59	0.1454478	0.28223301	3.54	1.127580759	0.146913015	0.140743915	2.133245908	0.498679846	3.56744777
Oct-10	0.151357768	2.000571777	59	0.00252263	0.290427	3.47	1.127580759	0.00158516	-0.00231782	0.046748853	-0.007980734	3.35685597
Nov-10	3.409292953	0.303136285	59	0.05682155	0.29931654	3.79	1.127580759	0.056714005	0.05183294	11.03835618	0.173170986	3.72048825
Dec-10	2.614875417	0.258601742	59	0.04358126	0.30975363	4.08	1.127580759	0.04316738	0.038418696	9.848639832	0.124029851	3.98758125
Jan-11	-7.625178028	7.499412973	59	-0.1270863	0.32125743	4.17	1.127580759	-0.13041827	-0.13244059	-1.02603738	-0.412256896	3.90391367
Feb-11	3.207521502	0.160462323	59	0.05345869	0.32829954	4.22	1.127580759	0.053172681	0.047987033	19.55093327	0.146168442	4.13279199
Mar-11	6.971396769	2.821924048	59	0.11618995	0.34257271	4.19	1.127580759	0.116975651	0.110480401	2.445694256	0.322502054	4.16652327
Apr-11	5.868097866	2.041773912	59	0.09780163	0.35927421	4.13	1.127580759	0.098292619	0.091813728	2.840306901	0.255553347	4.09013495
May-11	-2.067895247	3.569820634	59	-0.0344649	0.37870215	4.1	1.127580759	-0.03620726	-0.04077662	-0.59841342	-0.107674656	3.92886841
Jun-11	-4.089744606	4.999484025	59	-0.0681624	0.39831778	3.99	1.127580759	-0.07044482	-0.07480104	-0.83133471	-0.187792369	3.78883758
Jul-11	9.267647909	4.445618801	59	0.1544608	0.41908295	4.13	1.127580759	0.155912111	0.147476083	2.069186538	0.351901889	4.14679414
Aug-11	-6.163054435	6.465535466	59	-0.1027176	0.45263629	3.91	1.127580759	-0.10556307	-0.11026151	-0.96329548	-0.243598481	3.67694912
Sep-11	-15.53398058	13.09178089	59	-0.2588997	0.48154195	3.91	1.127580759	-0.26439233	-0.26692538	-1.19152218	-0.554313854	3.52076699
Oct-11	8.034848413	3.573897917	59	0.13391414	0.48096697	3.87	1.127580759	0.135090651	0.125898024	2.230155589	0.261760231	3.87491415
Nov-11	1.458318005	1.076411331	59	0.0243053	0.54826598	3.75	1.127580759	0.023657932	0.015167534	1.296732917	0.027664554	3.64930531
Dec-11	2.980593508	2.009705849	59	0.04967656	0.63104001	3.73	1.127580759	0.049464862	0.039159225	1.452166168	0.062055059	3.65534327

ภาคผนวก ง

ศัพท์เทคนิคที่ใช้ในการกำหนดการซื้อขาย SET50 Index Futures



ศัพท์เทคนิคที่ใช้ในการกำหนดการซื้อขาย SET50 Index Futures

ศัพท์เทคนิคต่าง ๆ ที่ใช้ในการกำหนดการซื้อขาย SET50 Index Futures มีรายละเอียด ดังนี้

- ตัวคูณดัชนี (Multiplier) เป็นราคาที่ใช้ในการคำนวณเมื่อค่าดัชนี SET50 เกิดการเปลี่ยนแปลง โดยได้กำหนดไว้ว่า SET50 Index 1 จุด มีค่าเท่ากับ 1,000 บาท ดังนั้น ถ้าผู้ลงทุนขาย SET50 Index Futures ที่ราคา 530 จุด ก็แสดงว่าสัญญาดังกล่าวนี้จะมีมูลค่า $520 \times 1,000 = 520,000$ บาท

- ช่วงห่างของราคาขั้นต่ำ (Tick Size) เป็นการกำหนดการเสนอราคาของดัชนี โดยการเสนอราคาซื้อหรือขายในแต่ละครั้งจะต้องเสนอในหน่วยทศนิยมหนึ่งตำแหน่ง เช่น ซื้อ SET50 Index Futures ที่ 522.00 หรือ 522.10 หรือ 522.20 เป็นต้น แต่ไม่สามารถกำหนดถึงทศนิยมตำแหน่งที่สองได้ เช่น 520.01 หรือ 520.02

- ช่วงของการเปลี่ยนแปลงสูงสุดในแต่ละวัน (Price Limit) เป็นการกำหนดราคาซื้อขาย Futures โดยจะสามารถเสนอซื้อขาย เพิ่มขึ้นหรือลดลงได้ไม่เกิน 30% ของราคาที่สำคัญหลักทรัพย์ประกาศไว้ในวันก่อนหน้าวันทำการปัจจุบัน เช่น ราคาของ SET50 Index Futures ที่สำนักหักบัญชีได้ประกาศใช้เมื่อวานนี้มีค่าเท่ากับ 500 จุด ดังนั้นการเคลื่อนไหวของราคาในวันนี้จะเปลี่ยนแปลงได้สูงสุดไม่เกินกว่า 350 จุด ถึง 650 จุด (บวกและลบด้วย 30%)

- Circuit Breaker เป็นการหยุดการซื้อขายเมื่อตลาดหลักทรัพย์หยุดทำการซื้อขาย โดยจะมี Circuit Breaker ครั้งที่ 1 จะทำงานเมื่อราคาของดัชนีตลาดหลักทรัพย์ลดลง 10% และตลาดหลักทรัพย์หยุดการซื้อขาย จะเปิดให้มีการซื้อขายเมื่อตลาดหลักทรัพย์เปิดทำการซื้อขายต่อไป สำหรับ Circuit Breaker ครั้งที่ 2 จะทำงานเมื่อตลาดหลักทรัพย์มีค่าดัชนีลดลง 20% และหยุดการซื้อขาย โดยจะเปิดให้มีการซื้อขายอีกครั้งเมื่อตลาดหลักทรัพย์เปิดให้มีการซื้อขายต่อไป และตลาดหลักทรัพย์จะให้ซื้อขายต่อไป แต่ราคาจะต้องไม่ต่ำกว่า 30% นอกจากนี้ การหยุดการซื้อขายของ SET50 Index Futures จะกระทำเมื่อตลาดหลักทรัพย์หยุดทุกครั้ง เช่น การหยุดทำการของตลาดหลักทรัพย์เมื่อเกิดเหตุการณ์ขัดข้องทางเทคนิค เป็นต้น

- เดือนที่สัญญาสิ้นอายุ (Maturity) สัญญา SET50 Index Futures นั้น จะมีรอบการครบกำหนดชำระราคาคือ ทุกสิ้นเดือนมีนาคม มิถุนายน กันยายน และธันวาคม ซึ่งเป็นไปตามมาตรฐานสากลนิยม โดยปกติแล้วการครบกำหนดตามสัญญาของ Futures Contract ระบบไตรมาสโดยทั่วไปนั้นจะมีรอบกำหนดระยะเวลาใหญ่ ๆ 2 แบบ คือ แบบ January Quarterly Cycle ซึ่งจะมีระยะเวลาครบรอบกำหนดระยะเวลาสิ้นสุดทุกเดือน มกราคม เมษายน กรกฎาคม และตุลาคม และแบบ March Quarterly Cycle คือครบกำหนดทุกสิ้นเดือน มีนาคม มิถุนายน กันยายน และธันวาคม

- Series Name ของ SET50 Index Futures นั้นเป็นการกำหนดตัวอักษรย่อ เพื่อให้เกิดความง่ายต่อการเข้าใจในการส่งคำสั่งซื้อหรือขายของนักลงทุน โดยจะมีการกำหนด Series Name เป็นสามส่วนคือ ส่วนที่ 1 จะ

ระบุชนิดของสินค้าที่จะทำการซื้อหรือขาย เช่น SET50 Index Futures จะถูกกำหนดเป็น S50 เป็นต้น สำหรับ ส่วนที่สองของ Series Name นั้นจะระบุถึงเดือนที่สัญญาจะครบกำหนดตามสัญญา ใช้ตัวอักษร 1 ตัวแทนชื่อ เดือนต่าง ๆ โดยมีวิธีการกำหนดชื่อเดือนตามหลักสากล ดังนี้ เดือน มกราคม ใช้อักษรย่อ F กุมภาพันธ์ G มีนาคม H เมษายน J พฤษภาคม K มิถุนายน M กรกฎาคม N สิงหาคม Q กันยายน U ตุลาคม V พฤศจิกายน X ธันวาคม Z สำหรับส่วนที่ 3 ของ Series Name เป็นการระบุถึงปีของการสิ้นสุดสัญญา เช่น 07 คือปี ค.ศ. 2007 เป็นต้น ดังนั้น การกำหนด Series Name เช่น S50M07 แสดงให้เห็นว่าคำสั่งการซื้อหรือการขาย SET50 Index Futures ในครั้งนี้เป็นสัญญาของ เดือนมิถุนายน ปี ค.ศ. 2007 หรือ S50H08 ก็แสดงให้เห็นว่าเป็นสัญญา SET50 Index Futures ของเดือนมีนาคม ปี ค.ศ. 2008 เป็นต้น

- วันซื้อขายวันสุดท้าย (Last Trading Day) คือ วันทำการของตลาดหลักทรัพย์ก่อนหน้าวันทำการวันสุดท้ายของเดือน เช่น เดือนมีนาคม 2549 วันทำการวันสุดท้ายของเดือนคือวันที่ 31 มีนาคม 2549 ดังนั้น Last Trading Day คือวันที่สามารถทำการซื้อขายวันสุดท้ายของเดือนได้ก็คือ วันที่ 30 มีนาคม 2549

- การจำกัดสถานะของสัญญา (Position Limit) เป็นจำนวนสัญญาที่ผู้ลงทุนสามารถถือครองได้ โดยทาง SET50 Index Futures กำหนดให้ผู้ลงทุนนั้นจะสามารถถือครองสัญญาที่กำลังจะหมดสถานะลงในแต่ละเดือนไม่เกินกว่า 20,000 สัญญา และสถานะสุทธิของทุกเดือนรวมกันไม่เกินกว่า 20,000 สัญญา เพื่อเป็นการป้องกันความเสียหายที่จะเกิดขึ้นในอนาคต

- การส่งมอบเงินสด (Cash Settlement) การซื้อขาย SET50 Index Futures เป็นการซื้อหรือขายดัชนี SET50 จึงทำให้การส่งมอบสินค้านั้นไม่สามารถทำได้จริง ดังนั้นการส่งมอบจึงเป็นแค่เพียงการชำระราคาส่วนต่างด้วยเงินสดเท่านั้น

- Daily Settlement Price (ราคาที่ใช้ชำระราคาประจำวัน) เป็นราคาที่ตลาดอนุพันธ์จะกำหนดทุกสิ้นวัน เพื่อทำการคำนวณผลกำไรหรือขาดทุนจากการลงทุนในตราสารอนุพันธ์นี้

- Final Settlement Price (ราคาที่ใช้ชำระราคาวันสุดท้าย) เป็นราคาที่ใช้คำนวณกำไรขาดทุนในวันสุดท้ายของสัญญา หรือวันครบกำหนดชำระตามสัญญา โดยสามารถคำนวณได้จากค่าเฉลี่ยของ SET50 Index ในช่วง 30 นาทีสุดท้ายของการซื้อขาย ในวันซื้อขายวันสุดท้ายตามสัญญา ซึ่งการคำนวณค่าเฉลี่ยนั้นจะใช้เทคนิคสองหลักของ SET50 Index รายนาที่ เพื่อเป็นการป้องกันการสร้างราคา หรือการปั่นหุ้น

สำหรับขั้นตอนการซื้อขาย SET50 Index Futures นั้น มีลักษณะการซื้อขายเช่นเดียวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ แต่มีสิ่งอื่น ๆ เล็กน้อยที่เพิ่มเติมเข้ามาในระบบทำให้การซื้อและขาย SET50 Index Futures แตกต่างไปจากการซื้อหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ กล่าวคือ การซื้อขาย SET50 Index Futures นั้น การสั่งซื้อและขายทุกครั้งจะต้องผ่านนายหน้า (Broker) โดยที่ผู้สั่งซื้อหรือขายนั้นจะต้องทำการวางเงิน

ประกันขึ้นต้นก่อนการซื้อขาย โดยที่จะมีการตรวจสอบสถานะทางบัญชีกันทุกวัน (Daily Mark-to-Market) ถ้าวันใดก็ตามผู้ลงทุนมีสถานะขาดทุนและเงินประกันต่ำกว่าเกณฑ์ที่กำหนด จะถูกเรียกวางเงินประกันเพิ่มจนเท่ากับเงินประกันเริ่มแรก และวันใดก็ตามที่มีสถานะกำไรก็จะสามารถถอนเงินออกไปใช้ได้ตามจำนวนกำไรที่เพิ่มขึ้นนั้น

