

ภาคผนวก ข

อัตราถ่วงความเสี่ยงจาก Multivariate GARCH model ในช่วง Out-sample

ตาราง ข.1

ประมาณการอัตราถ่วงความเสี่ยงระหว่างวันที่ 2 กรกฎาคม 2550 ถึง วันที่ 20 กรกฎาคม 2550

Date	DVEC-GARCH(1,1)	CC-GARCH(1,1)	BEKK-GARCH(1,1)
2/7/2550	0.9753	0.9657	0.8950
3/7/2550	0.8630	0.8786	0.9652
4/7/2550	0.9707	0.9869	1.0446
5/7/2550	0.8611	0.8881	0.8016
6/7/2550	0.9564	0.9433	0.9488
9/7/2550	0.8801	0.8728	0.8301
10/7/2550	0.8804	0.8788	0.8738
11/7/2550	0.8179	0.9781	0.8011
12/7/2550	1.1145	1.1481	1.1619
13/7/2550	0.9680	0.9848	0.9229
16/7/2550	0.9015	0.8985	0.9454
17/7/2550	0.7960	0.8158	1.0095
18/7/2550	0.9117	0.9034	0.9400
19/7/2550	0.7910	0.8122	1.0217
20/7/2550	0.9016	1.0096	0.8955

ตาราง ข.2

ประมาณการอัตราถ่วงความเสี่ยงระหว่างวันที่ 25 กรกฎาคม 2550 ถึง วันที่ 16 สิงหาคม 2550

Date	DVEC-GARCH(1,1)	CC-GARCH(1,1)	BEKK-GARCH(1,1)
25/7/2550	0.9052	0.9167	1.0332
26/7/2550	0.8691	0.8531	0.8617
27/7/2550	0.8862	0.8786	0.9420
31/7/2550	1.2102	1.2605	1.2428
1/8/2550	0.9526	0.9260	1.0219
2/8/2550	0.9667	1.0029	1.2194
3/8/2550	0.7976	0.8330	0.8213
6/8/2550	0.7786	0.8109	0.8283
7/8/2550	1.2823	1.3493	1.1993
8/8/2550	0.9154	0.9455	0.8377
9/8/2550	0.9844	0.9869	0.9653
10/8/2550	0.8693	0.9022	1.1719
14/8/2550	0.8798	0.8766	0.9319
15/8/2550	1.0924	1.2283	1.0021
16/8/2550	1.1900	1.2252	1.1879

ตาราง ข.3

ประมาณการอัตราถัวความระหว่างวันที่ 16 สิงหาคม 2550 ถึง วันที่ 5 กันยายน 2550

Date	DVEC-GARCH(1,1)	CC-GARCH(1,1)	BEKK-GARCH(1,1)
16/8/2550	1.1900	1.2252	1.1879
17/8/2550	0.9059	0.9300	1.1679
20/8/2550	0.6040	0.6548	0.8062
21/8/2550	0.8885	0.9280	1.1338
22/8/2550	0.9808	1.0067	1.1647
23/8/2550	0.9065	0.9050	0.8949
24/8/2550	0.7007	0.7438	0.8163
27/8/2550	0.8795	0.8653	0.8730
28/8/2550	0.8757	0.8665	0.8782
29/8/2550	0.8684	0.8680	0.9189
30/8/2550	0.6425	0.7796	0.8090
31/8/2550	0.8548	0.8606	0.8987
3/9/2550	0.8676	0.8947	1.0533
4/9/2550	0.8053	0.8141	0.7984
5/9/2550	1.0125	1.0174	1.0558

ตาราง ข.4

ประมาณการอัตราถัวความระหว่างวันที่ 30 ตุลาคม 2550 ถึง วันที่ 19 พฤศจิกายน 2550

Date	DVEC-GARCH(1,1)	CC-GARCH(1,1)	BEKK-GARCH(1,1)
30/10/2550	0.9805	0.9835	0.9851
31/10/2550	0.9530	0.9496	1.0586
1/11/2550	0.8798	0.9242	0.8345
2/11/2550	0.8704	0.8757	1.0044
5/11/2550	1.0371	1.0780	1.0074
6/11/2550	1.0614	1.0931	1.2082
7/11/2550	0.8750	0.8450	0.8402
8/11/2550	0.8519	0.8555	1.0318
9/11/2550	0.9582	1.0212	0.9210
12/11/2550	0.9448	0.9382	0.8613
13/11/2550	1.0570	1.0726	1.1276
14/11/2550	0.9866	0.9815	0.9697
15/11/2550	0.8992	0.8773	0.8556
16/11/2550	0.9066	0.9135	1.0651
19/11/2550	1.0084	1.0220	1.0199