

ภาคผนวก ซ

จำนวนสัญญาณจาก Multivariate GARCH Model ใน Out-sample

ตาราง ซ.1

ประมาณการอัตราถัวความเสี่ยงระหว่างวันที่ 2 กรกฎาคม 2550 ถึง วันที่ 20 กรกฎาคม 2550

Date	DVEC-GARCH(1,1)	CC-GARCH(1,1)	BEKK-GARCH(1,1)
2/7/2550	86	85	79
3/7/2550	76	77	85
4/7/2550	86	88	93
5/7/2550	77	79	71
6/7/2550	85	84	84
9/7/2550	78	77	73
10/7/2550	79	79	78
11/7/2550	73	87	72
12/7/2550	99	102	103
13/7/2550	86	87	82
16/7/2550	81	81	85
17/7/2550	71	73	91
18/7/2550	83	82	86
19/7/2550	71	73	92
20/7/2550	81	91	80

ตาราง ซ.2

ประมาณการอัตราถัวความเสี่ยงระหว่างวันที่ 25 กรกฎาคม 2550 ถึง วันที่ 16 สิงหาคม 2550

Date	DVEC-GARCH(1,1)	CC-GARCH(1,1)	BEKK-GARCH(1,1)
25/7/2550	72	72	82
26/7/2550	69	68	69
27/7/2550	70	70	75
31/7/2550	96	100	99
1/8/2550	77	75	82
2/8/2550	77	80	97
3/8/2550	64	67	66
6/8/2550	62	65	66
7/8/2550	101	107	95
8/8/2550	72	75	66
9/8/2550	79	80	78
10/8/2550	70	73	94
14/8/2550	70	69	74
15/8/2550	86	97	79
16/8/2550	96	98	96

ตาราง ๓.3

ประมาณการอัตราถัวความเสี่ยงระหว่างวันที่ 16 สิงหาคม 2550 ถึง วันที่ 5 กันยายน 2550

Date	DVEC-GARCH(1,1)	CC-GARCH(1,1)	BEKK-GARCH(1,1)
16/8/2550	115	118	115
17/8/2550	86	88	111
20/8/2550	56	61	75
21/8/2550	84	87	107
22/8/2550	93	95	110
23/8/2550	85	84	84
24/8/2550	66	70	77
27/8/2550	83	82	83
28/8/2550	83	83	84
29/8/2550	81	81	86
30/8/2550	60	73	76
31/8/2550	80	80	84
3/9/2550	81	84	99
4/9/2550	76	77	75
5/9/2550	96	96	100

ตาราง ๓.4

ประมาณการอัตราถัวความเสี่ยงระหว่างวันที่ 30 ตุลาคม 2550 ถึง วันที่ 19 พฤศจิกายน 2550

Date	DVEC-GARCH(1,1)	CC-GARCH(1,1)	BEKK-GARCH(1,1)
30/10/2550	72	72	72
31/10/2550	69	69	77
1/11/2550	65	68	61
2/11/2550	64	64	73
5/11/2550	76	79	74
6/11/2550	78	80	89
7/11/2550	65	63	63
8/11/2550	63	63	76
9/11/2550	70	75	68
12/11/2550	70	69	63
13/11/2550	78	79	83
14/11/2550	73	72	72
15/11/2550	67	65	64
16/11/2550	67	68	79
19/11/2550	76	77	77