

ตารางภาคผนวกที่ 9

ตัวอย่างการคำนวณสัดส่วนการลงทุนในทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ ใน Portfolio

ในช่วงวิกฤติเศรษฐกิจหลังจากประกาศค่าเงินบาทลอยตัวจนถึง ปี พ.ศ. 2543

ณ สัปดาห์สุดท้ายของทุกเดือน

สัปดาห์	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
3	25 ก.ค. 40	SET Index	-2.97	4.24	1.00	-0.72											
		GOLD	1.39	3.15	0.39	0.42	0.91	5.76	0.15	0.60	0.91	2.40	0.36		0.18	3.04	0.04
		JAS	0.18	3.04	0.59	0.04				0.40				1.00			
8	29 ส.ค. 40	SET Index	0.16	7.28	1.00	0.01											
		GOLD	1.91	3.16	0.28	0.59	4.81	10.03	0.47	0.16	4.81	9.52	0.50		4.81	10.79	0.44
		SCB	5.03	10.91	1.45	0.46				0.37				0.33			
		THAI	6.37	14.49	1.73	0.44				0.25				0.01			
		LH	4.67	12.91	0.89	0.36				0.22				0.66			
12	26 ก.ย. 40	SET Index	-1.06	4.65	1.00	-0.24											
		GOLD	0.99	4.23	0.22	0.22	1.66	6.34	0.25	0.39	1.66	2.67	0.60		1.66	3.31	0.48
		JAS	2.73	2.52	0.35	1.06				0.40				0.43			
		TT&T	0.86	5.02	0.73	0.16				0.21				0.57			
17	31 ต.ค. 40	SET Index	-4.10	8.10	1.00	-0.51											
		GOLD	-0.46	2.40	0.25	-0.22	-1.37	9.37	-0.15	0.01	-1.37	4.76	-0.30		-1.37	4.75	-0.30
		ADVANC	-1.42	10.18	0.54	-0.14				0.04				0.04			

สัปดาห์	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		KTB	-4.49	22.66	2.64	-0.20				0.07				0.07			
		PTTEP	-1.03	5.24	0.50	-0.21				0.38				0.39			
		NPC	-1.20	5.65	0.17	-0.22				0.50				0.50			
21	28 พ.ย. 40	SET Index	-3.17	4.81	1.00	-0.67											
		GOLD	2.11	5.22	0.36	0.39	2.33	7.29	0.31	0.63	2.33	1.60	1.42		2.33	7.27	0.31
		ADVANC	2.91	8.06	1.02	0.35				0.04				0.32			
		THAI	2.74	9.40	-0.29	0.29				0.32				0.43			
		EGCOMP	0.88	10.12	1.65	0.08				0.01				0.25			
26	31 ธ.ค. 40	SET Index	7.05	8.67	1.00	0.81											
		GOLD	4.41	6.70	-0.45	0.65	13.83	10.64	1.29	0.01	13.83	6.62	2.08		13.83	6.54	2.11
		NPC	10.22	8.33	-0.40	1.22				0.49				0.50			
		TT&T	21.60	18.29	1.90	1.18				0.24				0.24			
		SCCC	14.75	12.75	0.98	1.15				0.16				0.17			
		SHIN	12.04	11.54	1.13	1.04				0.09				0.09			
30	30 ม.ค. 41	SET Index	6.68	8.80	1.00	0.75											
		GOLD	-2.11	7.44	0.10	-0.29	17.19	15.06	1.14	0.11	17.19	11.43	1.50		17.19	11.49	1.49
		LH	22.40	24.58	0.87	0.91				0.42				0.37			
		SHIN	8.87	10.14	0.81	0.87				0.15				0.36			
		JAS	21.17	25.24	2.17	0.84				0.32				0.27			
34	27 ก.พ. 41	SET Index	-2.03	3.20	1.00	-0.65											
		GOLD	-1.63	5.36	0.19	-0.31	-1.23	4.29	-0.30	0.03	-1.23	0.62	-2.08		-1.23	0.63	-2.03

ลำดับ	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		BCP	4.23	5.13	1.07	0.81				0.00				0.01			
		SCC	0.59	5.76	0.84	0.09				0.18				0.17			
		SCCC	-1.18	5.07	-0.48	-0.24				0.46				0.47			
		BAY	-2.33	5.09	0.72	-0.47				0.32				0.35			
38	27 มี.ค. 41	SET Index	-3.17	2.83	1.00	-1.14											
		GOLD	0.55	2.24	0.02	0.22	-2.95	4.40	-0.68	0.49	-2.95	1.72	-1.75		-4.87	7.96	-0.62
		JAS	-4.81	8.14	1.16	-0.60				0.21				0.98			
		BAY	-10.35	12.67	1.09	-0.82				0.13				0.01			
		SCB	-5.19	4.99	1.03	-1.05				0.17				0.01			
		COCO	-5.16	4.79	1.46	-1.09				0.00							
43	30 เม.ย. 41	SET Index	-5.16	2.23	1.00	-2.34											
		GOLD	-1.50	1.83	0.48	-0.85	-3.59	4.75	-0.77	0.01	-3.59	0.73	-5.00		-3.59	0.70	-5.17
		ITD	-2.18	8.15	-2.41	-0.27				0.50				0.51			
		COCO	-2.55	6.97	0.53	-0.37				0.14				0.15			
		TT&T	-5.54	13.95	2.83	-0.40				0.25				0.26			
		SCCC	-7.79	13.79	5.52	-0.57				0.09				0.09			
47	29 พ.ค. 41	SET Index	-5.60	5.45	1.00	-1.04											
		GOLD	1.19	3.84	0.51	0.29	1.03	5.79	0.17	1.00	1.03	5.79	0.17				
51	26 มิ.ย. 41	SET Index	-0.47	6.32	1.00	-0.08											
		GOLD	-0.70	1.33	0.04	-0.56	2.36	3.60	0.64	0.18	2.36	3.52	0.65		2.36	5.13	0.45
		JAS	4.41	7.28	0.82	0.60				0.09				0.01			

สัปดาห์	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		BEC	3.47	6.63	0.22	0.51				0.36				0.07			
		PTTEP	2.25	5.54	0.40	0.40				0.37				0.92			
56	31 ก.ค. 41	SET Index	-4.45	3.14	1.00	-1.44											
		GOLD	-1.27	1.47	0.25	-0.90	0.83	6.12	0.13	0.27	0.83	2.37	0.33		0.83	10.11	0.08
		SCCC	1.85	4.64	0.82	0.39				0.62				0.39			
		ITD	0.17	18.40	0.94	0.01				0.11				0.61			
60	28 ส.ค. 41	SET Index	1.09	8.17	1.00	0.13											
		GOLD	0.39	2.75	0.22	0.12	4.08	11.06	0.36	0.25	4.08	9.54	0.42		5.33	11.96	0.44
		JAS	5.33	11.96	1.29	0.44				0.75				1.00			
64	25 ก.ย. 41	SET Index	7.88	6.86	1.00	1.14											
		GOLD	-0.94	2.72	0.27	-0.36	8.48	4.62	1.82	0.01	8.48	3.71	2.27		8.48	3.70	2.28
		BCP	6.78	3.72	0.53	1.81				0.71				0.73			
		IFCT	12.95	8.63	0.08	1.49				0.26				0.25			
		COCO	15.14	11.95	1.58	1.26				0.02				0.02			
69	30 ต.ค. 41	SET Index	3.42	10.01	1.00	0.34											
		GOLD	-0.61	2.06	-0.16	-0.32	10.48	16.74	0.62	0.33	10.48	6.82	1.53		10.48	8.68	1.20
		ITD	21.18	14.24	0.83	1.48				0.46				0.35			
		BECL	4.74	10.46	0.87	0.45				0.21				0.65			
73	27 พ.ย. 41	SET Index	-0.68	6.64	1.00	-0.11											
		GOLD	-0.75	1.05	0.02	-0.77	2.08	6.36	0.32	0.01	2.08	4.09	0.49		2.08	4.05	0.50
		BECL	2.83	9.49	0.90	0.29				0.46				0.44			

ลำดับ	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		COCO	1.48	6.63	0.03	0.21				0.53				0.56			
78	30 ธ.ค. 41	SET Index	0.55	6.76	1.00	0.07											
		GOLD	0.25	0.74	0.10	0.26	3.58	11.57	0.30	0.01	3.58	4.79	0.73		3.58	4.79	0.74
		BAY	2.17	3.04	0.22	0.69				0.83				0.84			
		SCCC	11.10	17.81	2.59	0.62				0.16				0.16			
82	29 ม.ค. 42	SET Index	-1.90	3.93	1.00	-0.50											
		GOLD	0.29	0.70	-0.10	0.34	0.29	0.70	0.34	1.00	0.15	0.35	0.26				
86	26 ก.พ. 42	SET Index	1.78	3.00	1.00	0.57											
		GOLD	-0.35	1.46	-0.31	-0.28	1.93	1.26	1.49	0.01	1.93	1.21	1.55		1.93	1.21	1.55
		SHIN	1.46	1.34	0.38	1.05				0.09				0.08			
		THAI	2.76	3.68	-0.10	0.74				0.23				0.23			
		SCCC	5.21	7.25	1.26	0.71				0.17				0.17			
		SCC	0.58	0.75	-0.02	0.70				0.50				0.52			
90	26 มี.ค. 42	SET Index	1.83	4.35	1.00	0.41											
		GOLD	0.02	0.75	0.03	-0.05	5.44	5.32	1.01	0.01	5.44	3.17	1.70		5.44	3.15	1.71
		PTTEP	3.61	4.19	0.53	0.85				0.26				0.27			
		NPC	12.37	16.18	1.67	0.76				0.16				0.16			
		SCCC	4.88	6.54	0.22	0.74				0.08				0.08			
		ITD	4.35	7.13	0.29	0.60				0.49				0.50			
95	30 เม.ย. 42	SET Index	2.73	7.92	1.00	0.34											
		GOLD	-1.34	0.91	0.07	-1.52	8.92	10.98	0.81	0.44	8.92	5.59	1.59		8.92	8.32	1.07

สัปดาห์	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		JAS	18.32	14.68	-0.45	1.24				0.37				0.17			
		BAY	16.13	23.63	2.82	0.68				0.15				0.29			
		BBL	4.65	9.33	1.10	0.49				0.03				0.25			
99	28 พ.ค. 42	SET Index	2.65	4.72	1.00	0.55											
		GOLD	-1.11	1.04	0.00	-1.11	11.16	9.56	1.16	0.34	11.16	5.89	1.89		17.59	8.80	1.99
		JAS	19.26	14.74	-1.53	1.30				0.38				0.60			
		TT&T	15.05	17.82	2.59	0.84				0.28				0.40			
103	25 มิ.ย. 42	SET Index	-1.66	3.77	1.00	-0.46											
		GOLD	-0.03	1.07	0.10	-0.08	2.90	9.26	0.31	0.01	2.90	4.90	0.58		2.90	4.88	0.58
		PTTEP	1.70	2.52	0.30	0.65				0.64				0.66			
		SHIN	5.23	10.92	2.63	0.47				0.35				0.34			
108	30 ก.ค. 42	SET Index	-0.71	4.24	1.00	-0.18											
		GOLD	0.41	1.79	-0.26	0.20	1.34	6.22	0.21	0.47	1.34	0.57	2.28		1.34	3.28	0.39
		ADVANC	2.51	2.29	0.33	1.07				0.44				0.45			
		SCCC	0.40	5.33	0.59	0.06				0.08				0.55			
112	27 ส.ค. 42	SET Index	-2.62	6.73	1.00	-0.40											
		GOLD	2.34	3.83	-0.51	0.60	1.86	7.58	0.24	0.62	1.86	2.04	0.88		1.86	5.29	0.34
		BEC	1.99	5.04	0.50	0.38				0.14				0.91			
		BANPU	0.58	10.93	1.38	0.05				0.25				0.09			
116	24 ก.ย. 42	SET Index	-2.76	6.90	1.00	-0.41											
		GOLD	3.20	7.82	0.12	0.40	1.54	4.96	0.30	0.43	1.54	4.70	0.31		1.25	8.01	0.15

ลำดับ	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		BANPU	1.26	8.03	0.66	0.15				0.06				0.99			
		SCC	0.17	6.47	0.65	0.02				0.51				0.01			
121	29 ต.ค. 42	SET Index	1.87	4.27	1.00	0.42											
		GOLD	-0.47	2.13	-0.34	-0.25	4.09	5.23	0.77	0.01	4.09	3.40	1.18		4.09	3.37	1.19
		SHIN	4.60	5.11	0.76	0.89				0.65				0.63			
		IFCT	3.20	5.53	0.76	0.57				0.33				0.37			
125	26 พ.ย. 42	SET Index	2.33	2.32	1.00	0.97											
		GOLD	-0.92	2.45	0.41	-0.40	4.07	2.33	1.72	0.05	4.07	1.59	2.52		4.07	1.61	2.49
		NPC	2.39	1.58	-0.04	1.47				0.73				0.80			
		SHIN	10.87	7.75	0.14	1.39				0.22				0.20			
130	30 ธ.ค. 42	SET Index	0.77	4.33	1.00	0.16											
		GOLD	-0.12	1.38	0.26	-0.14	2.55	3.23	0.77	0.01	2.55	2.93	0.85		2.55	2.93	0.85
		UCOM	4.24	6.23	0.29	0.67				0.30				0.30			
		KBANK	0.96	1.62	0.29	0.55				0.54				0.56			
		BEC	5.12	10.37	1.95	0.49				0.15				0.15			
134	28 ม.ค. 43	SET Index	-3.14	4.24	1.00	-0.76											
		GOLD	0.80	3.66	0.05	0.20	1.73	8.43	0.20	0.81	1.73	5.89	0.28		5.60	18.12	0.31
		UCOM	5.60	18.12	2.53	0.31				0.19				1.00			
138	25 ก.พ. 43	SET Index	-0.15	3.89	1.00	-0.05											
		GOLD	-1.40	1.57	0.21	-0.93	3.15	4.46	0.69	0.18	3.15	1.84	1.68		3.15	2.77	1.11
		ITD	7.28	6.77	0.00	1.07				0.34				0.24			

ลำดับ	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		PTTEP	2.11	7.62	0.32	0.27				0.30				0.40			
		SCCC	1.62	7.28	0.90	0.21				0.18				0.37			
143	31 มี.ค. 43	SET Index	-0.66	2.74	1.00	-0.26											
		GOLD	-0.55	1.54	0.21	-0.40	1.68	3.97	0.41	0.01	1.68	2.30	0.70		1.68	2.26	0.72
		NPC	1.46	2.14	0.55	0.65				0.81				0.83			
		COCO	4.59	13.47	3.42	0.34				0.03				0.02			
		BAY	2.46	7.55	1.81	0.32				0.15				0.15			
147	28 เม.ย. 43	SET Index	-4.47	4.13	1.00	-1.10											
		GOLD	0.01	1.75	0.02	-0.03	-0.05	3.91	-0.03	0.50	-0.05	3.91	-0.03		-0.10	8.21	-0.02
		UCOM	-0.10	8.21	1.41	-0.02				0.50				1.00			
151	26 พ.ค. 43	SET Index	-0.44	6.30	1.00	-0.08											
		GOLD	0.95	2.13	0.28	0.42	2.96	5.54	0.52	0.01	2.96	3.28	0.88		2.96	3.28	0.89
		ADVANC	0.98	0.97	0.12	0.95				0.68				0.69			
		SCCC	7.36	9.60	1.05	0.76				0.31				0.31			
156	30 มิ.ย. 43	SET Index	-2.63	1.37	1.00	-1.96											
		GOLD	0.55	0.93	-0.57	0.53	1.20	2.41	0.48	0.65	1.20	0.90	1.28		1.20	4.45	0.26
		EGCOMP	2.86	3.39	0.36	0.83				0.25				0.04			
		COCO	1.96	4.42	2.02	0.43				0.05				0.44			
		THAI	0.45	7.09	2.60	0.06				0.05				0.52			
160	28 ก.ค. 43	SET Index	0.16	4.63	1.00	0.02											
		GOLD	-0.15	1.83	-0.14	-0.11	2.41	1.43	1.65	0.32	2.41	0.83	2.84		2.41	2.03	1.16

สัปดาห์	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		PTTEP	6.65	2.75	0.16	2.40				0.29				0.19			
		SCCC	1.39	2.99	0.02	0.45				0.40				0.81			
164	25 ส.ค. 43	SET Index	-2.96	3.02	1.00	-1.00											
		GOLD	0.79	1.52	-0.06	0.49	0.80	4.60	0.16	0.50	0.80	4.60	0.16		0.81	9.33	0.08
		UCOM	0.81	9.33	2.90	0.08				0.50				1.00			
169	29 ก.ย. 43	SET Index	0.13	5.39	1.00	0.01											
		GOLD	-0.34	2.48	-0.22	-0.16	2.02	5.11	0.39	0.01	2.02	4.24	0.46		2.02	4.23	0.47
		KBANK	1.02	2.08	0.34	0.47				0.54				0.56			
		BBL	3.63	8.64	1.27	0.41				0.23				0.23			
		SCB	2.88	6.84	0.98	0.41				0.22				0.21			
173	27 ต.ค. 43	SET Index	0.67	3.02	1.00	0.20											
		GOLD	-0.26	1.28	0.15	-0.24	1.98	2.41	0.80	0.19	1.98	1.47	1.31		1.98	1.73	1.12
		LH	2.89	1.89	0.43	1.50				0.54				0.43			
		COCO	3.50	5.15	0.37	0.67				0.06				0.01			
		SCCC	1.19	3.30	0.50	0.35				0.15				0.39			
		TT&T	1.43	4.32	0.98	0.32				0.06				0.17			
177	24 พ.ย. 43	SET Index	-1.94	1.77	1.00	-1.12											
		GOLD	-0.31	1.29	-0.15	-0.28	0.12	1.61	0.05	0.50	0.12	1.61	0.05		0.56	2.51	0.20
		SCCC	0.56	2.51	0.69	0.20				0.50				1.00			
182	29 ธ.ค. 43	SET Index	4.50	3.23	1.00	1.38											
		GOLD	-0.36	2.13	-0.46	-0.19	4.89	2.47	1.96	0.01	4.89	1.61	3.00		4.89	1.59	3.04

สัปดาห์	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		PTTEP	2.55	1.19	0.09	2.11				0.75				0.76			
		LH	12.46	8.18	0.63	1.52				0.24				0.24			

ตารางภาคผนวกที่ 10

ตัวอย่างการคำนวณสัดส่วนการลงทุนในทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ ใน Portfolio
ในปี พ.ศ. 2544 – พ.ศ. 2547 ณ สัปดาห์สุดท้ายของทุกเดือน

สัปดาห์	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
4	26 ม.ค. 44	SET Index	0.51	3.32	1.00	0.14											
		GOLD	-0.31	1.71	0.26	-0.21	3.05	4.81	0.63	0.15	3.05	3.89	0.77		3.05	3.95	0.76
		BECL	3.44	4.43	1.01	0.77				0.72				0.27			
		BANPU	4.79	8.78	-0.49	0.54				0.13				0.26			
		SCB	1.91	4.50	1.33	0.42				0.00				0.48			
8	23 ก.พ. 44	SET Index	-1.64	3.41	1.00	-0.49											
		GOLD	1.23	2.17	0.39	0.55	1.02	2.61	0.38	0.31	1.02	1.70	0.58		0.94	1.76	0.51
		EGCOMP	0.95	1.78	0.16	0.51				0.65				0.99			
		LH	0.62	5.58	0.71	0.10				0.03				0.01			
13	30 มี.ค. 44	SET Index	0.50	2.46	1.00	0.19											
		GOLD	0.80	0.98	-0.03	0.78	1.94	1.26	1.51	0.01	1.94	0.76	2.48		1.94	0.76	2.49
		LH	4.83	6.60	0.45	0.73				0.17				0.17			
		BECL	1.83	2.53	0.47	0.71				0.27				0.28			
		BANPU	1.12	2.05	0.12	0.52				0.55				0.55			
17	27 เม.ย. 44	SET Index	1.27	2.71	1.00	0.45											
		GOLD	0.87	0.46	-0.09	1.81	3.96	1.89	2.07	0.01	3.96	1.52	2.58		3.96	1.52	2.58

สัปดาห์	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		BANPU	6.43	4.38	-0.51	1.46				0.32				0.32			
		SCC	7.09	6.05	1.72	1.17				0.09				0.09			
		BECL	1.85	1.98	-0.16	0.92				0.48				0.49			
		PTTEP	3.57	6.13	-0.17	0.58				0.09				0.09			
21	25 พ.ค. 44	SET Index	1.19	2.33	1.00	0.49											
		GOLD	-0.05	2.47	0.53	-0.04	2.11	0.98	2.10	0.16	2.11	0.93	2.22		2.11	1.09	1.88
		EGCOMP	3.41	1.75	0.36	1.92				0.17				0.01			
		ADVANC	1.86	1.45	0.55	1.25				0.45				0.82			
		PTTEP	3.22	3.05	-0.15	1.04				0.22				0.17			
26	29 มิ.ย. 44	SET Index	-1.11	2.22	1.00	-0.53											
		GOLD	-0.36	1.31	-0.04	-0.32	0.63	2.75	0.20	0.27	0.63	0.68	0.83		0.63	2.31	0.24
		CPF	2.43	8.74	2.44	0.27				0.21				0.11			
		LH	0.41	3.57	-0.89	0.10				0.52				0.89			
30	27 ก.ค. 44	SET Index	1.29	3.24	1.00	0.38											
		GOLD	-0.38	1.99	0.02	-0.22	2.38	1.72	1.35	0.01	2.38	1.19	1.95		2.38	1.18	1.96
		LH	4.92	4.09	0.51	1.19				0.18				0.17			
		THAI	2.34	2.40	0.16	0.95				0.28				0.29			
		SCCC	2.58	3.79	-0.04	0.66				0.10				0.11			
		DELTA	1.35	2.69	0.43	0.48				0.43				0.43			
35	31 ส.ค. 44	SET Index	-3.32	7.48	1.00	-0.45											
		GOLD	1.50	1.52	-0.16	0.94	0.87	1.89	0.43	0.50	0.87	1.89	0.43		0.24	4.94	0.04

[illegible]

สัปดาห์	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		GOLD	0.18	1.71	-0.05	0.08	4.09	1.67	2.42	0.01	4.09	1.41	2.86		4.09	1.40	2.88
		CPF	2.50	1.73	0.14	1.42				0.49				0.51			
		SCC	5.96	4.48	-0.07	1.32				0.21				0.21			
		KK	6.57	5.05	1.39	1.29				0.07				0.07			
		LH	5.24	5.91	0.59	0.88				0.22				0.22			
56	25 ม.ค. 45	SET Index	2.16	5.30	1.00	0.40											
		GOLD	0.72	3.72	0.13	0.18	6.50	5.56	1.16	0.17	6.50	2.81	2.30		6.70	5.78	1.15
		UBC	7.83	3.43	0.01	2.27				0.65				0.01			
		KK	6.68	5.80	0.98	1.14				0.07				0.98			
		BECL	7.37	11.89	1.65	0.62				0.11				0.01			
60	22 ก.พ. 45	SET Index	0.98	5.64	1.00	0.17											
		GOLD	-0.45	1.91	0.08	-0.26	5.81	9.47	0.61	0.22	5.81	9.00	0.64		5.81	9.31	0.62
		VNT	13.08	19.66	3.19	0.66				0.33				0.23			
		SCC	3.67	7.65	1.08	0.47				0.45				0.77			
65	29 มี.ค. 45	SET Index	-0.64	2.81	1.00	-0.24											
		GOLD	0.77	1.26	-0.41	0.58	1.59	3.24	0.48	0.57	1.59	0.87	1.79		2.04	7.93	0.25
		THAI	3.06	4.44	-0.26	0.68				0.27				0.01			
		LH	2.03	8.03	2.62	0.25				0.16				0.99			
69	26 เม.ย. 45	SET Index	0.31	2.54	1.00	0.11											
		GOLD	1.03	1.66	0.29	0.59	2.41	4.33	0.55	0.01	2.41	3.50	0.68		2.41	3.49	0.68
		HANA	1.55	2.17	0.25	0.69				0.70				0.72			

สัปดาห์	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		SCCC	3.28	6.30	2.21	0.51				0.04				0.03			
		LH	4.76	11.58	3.94	0.41				0.25				0.25			
74	31 พ.ค. 45	SET Index	-0.09	4.08	1.00	-0.03											
		GOLD	-0.77	1.35	0.08	-0.60	1.56	5.27	0.29	0.01	1.56	3.93	0.39		1.56	3.90	0.39
		THAI	3.56	10.41	2.17	0.34				0.12				0.12			
		SCC	1.68	7.63	1.39	0.21				0.36				0.36			
		BAY	1.03	4.66	0.28	0.21				0.51				0.52			
78	28 มิ.ย. 45	SET Index	-1.46	3.67	1.00	-0.41											
		GOLD	-1.20	1.50	0.10	-0.83	0.09	5.79	0.01	0.06	0.09	3.62	0.01		0.18	3.81	0.04
		UBC	0.18	3.81	0.74	0.04				0.94				1.00			
82	26 ก.ค. 45	SET Index	-1.37	3.45	1.00	-0.41											
		GOLD	-0.17	2.30	0.29	-0.09	0.82	3.37	0.23	0.06	0.82	0.29	2.65		0.82	0.88	0.88
		DELTA	0.74	1.75	-0.31	0.40				0.71				0.86			
		PTTEP	1.31	4.80	1.09	0.26				0.24				0.14			
87	30 ส.ค. 45	SET Index	-1.58	1.68	1.00	-0.96											
		GOLD	1.41	1.19	0.17	1.15	1.61	1.59	0.99	0.75	1.61	0.59	2.66		1.61	2.70	0.58
		ADVANC	3.07	4.12	-0.19	0.74				0.17				0.46			
		PTTEP	0.35	2.21	0.22	0.14				0.08				0.54			
91	27 ก.ย. 45	SET Index	-0.14	3.14	1.00	-0.06											
		GOLD	-0.50	0.71	-0.12	-0.75	1.19	2.11	0.55	0.22	1.19	1.81	0.64		1.53	2.72	0.55
		DELTA	1.52	2.77	0.19	0.54				0.49				0.98			

[illegible]

สัปดาห์	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		GOLD	-1.19	1.80	0.20	-0.68	1.96	1.01	1.91	0.06	1.96	0.00	N/A		1.96	0.27	7.18
		ADVANC	3.34	1.30	-0.50	2.54				0.22				0.14			
		KBANK	2.08	1.48	0.88	1.39				0.14				0.01			
		SCC	1.58	1.80	0.56	0.86				0.20				0.36			
		SCCC	1.78	2.56	1.60	0.68				0.02				0.10			
		BAY	2.33	3.90	1.23	0.59				0.09				0.11			
		HANA	1.69	2.84	-1.05	0.59				0.27				0.28			
117	28 มี.ค. 46	SET Index	0.30	2.71	1.00	0.10											
		GOLD	0.02	1.67	-0.47	0.00	2.10	3.04	0.68	0.09	2.10	2.56	0.81		2.10	2.59	0.80
		EGCOMP	1.45	2.21	0.51	0.64				0.61				0.74			
		HANA	3.99	6.78	1.91	0.58				0.31				0.26			
121	25 เม.ย. 46	SET Index	0.60	2.98	1.00	0.19											
		GOLD	2.13	0.98	0.02	2.14	2.47	2.51	0.97	0.73	2.47	1.29	1.89		2.47	3.45	0.71
		EGCOMP	3.68	4.29	0.99	0.85				0.21				0.10			
		ADVANC	2.33	3.54	0.61	0.65				0.05				0.90			
126	30 พ.ค. 46	SET Index	2.97	1.80	1.00	1.63											
		GOLD	-1.33	1.99	1.01	-0.68	3.17	0.47	6.69	0.16	3.17	0.00	N/A		3.17	0.84	3.72
		BECL	5.36	3.12	0.19	1.71				0.20				0.01			
		SCC	3.77	2.91	-0.70	1.29				0.15				0.13			
		BANPU	2.93	2.55	-0.50	1.14				0.15				0.41			
		VNT	3.69	3.35	0.85	1.09				0.03				0.01			

สัปดาห์	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		PTTEP	3.02	3.01	0.48	0.99				0.11				0.24			
		SHIN	3.25	3.60	1.52	0.90				0.06				0.19			
		CPF	4.66	5.47	-1.29	0.85				0.14				0.01			
130	27 มิ.ย. 46	SET Index	1.45	4.23	1.00	0.34											
		GOLD	0.49	3.39	-0.03	0.14	2.67	1.32	2.01	0.17	2.67	0.96	2.75		2.67	1.16	2.29
		BEC	2.13	1.95	0.36	1.08				0.22				0.55			
		THAI	4.45	6.05	-0.23	0.73				0.31				0.20			
		CPF	2.47	5.32	0.37	0.46				0.31				0.25			
134	25 ก.ค. 46	SET Index	1.66	1.98	1.00	0.82											
		GOLD	0.74	3.50	-1.13	0.20	3.87	4.38	0.88	0.13	3.87	4.20	0.92		3.87	7.55	0.51
		BECL	4.52	8.03	2.61	0.56				0.23				0.10			
		BAY	5.02	9.83	2.29	0.51				0.26				0.01			
		LH	3.79	8.65	2.38	0.44				0.38				0.89			
139	29 ส.ค. 46	SET Index	1.68	1.55	1.00	1.06											
		GOLD	0.65	1.96	-0.67	0.32	1.82	1.42	1.26	0.07	1.82	1.20	1.49		1.82	1.25	1.44
		BANPU	2.84	3.32	-0.79	0.85				0.27				0.22			
		SCC	1.67	2.01	0.62	0.82				0.37				0.44			
		SHIN	1.35	2.18	1.17	0.61				0.29				0.34			
143	26 ก.ย. 46	SET Index	1.48	3.22	1.00	0.45											
		GOLD	0.17	3.21	0.11	0.04	2.85	2.53	1.12	0.01	2.85	1.89	1.50		2.85	1.88	1.50
		BANPU	7.36	7.80	1.59	0.94				0.29				0.29			

ลำดับ	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		SCC	1.03	1.86	0.04	0.54				0.70				0.71			
148	31 ต.ค. 46	SET Index	1.30	5.42	1.00	0.23											
		GOLD	0.57	2.40	-0.15	0.23	3.20	3.15	1.01	0.50	3.20	3.14	1.01		5.83	8.09	0.72
		TMB	5.83	8.09	0.99	0.72				0.50				1.00			
152	28 พ.ย. 46	SET Index	3.69	1.53	1.00	2.39											
		GOLD	0.59	0.31	0.00	1.82	5.26	0.94	5.56	0.21	5.26	0.07	72.68		5.81	5.31	1.09
		SHIN	7.31	3.35	-1.71	2.18				0.22				0.01			
		ADVANC	6.09	3.12	1.24	1.95				0.13				0.01			
		BANPU	6.72	3.75	-0.82	1.79				0.19				0.01			
		KTB	5.79	5.55	1.50	1.04				0.26				0.97			
157	31 ธ.ค. 46	SET Index	-0.91	4.69	1.00	-0.20											
		GOLD	-0.69	2.14	0.24	-0.33	2.03	5.05	0.40	0.16	2.03	4.49	0.45		2.05	8.60	0.24
		PTTEP	3.98	9.27	1.66	0.43				0.20				0.01			
		VNT	2.12	6.31	0.69	0.33				0.27				0.01			
		SCCC	2.10	6.54	0.92	0.32				0.25				0.01			
		THAI	2.03	8.80	1.07	0.23				0.12				0.97			
161	30 ม.ค. 47	SET Index	-0.93	5.16	1.00	-0.18											
		GOLD	-0.56	1.98	0.35	-0.30	1.36	3.19	0.42	0.15	1.36	1.78	0.75		1.36	1.87	0.71
		DELTA	2.49	2.80	0.29	0.88				0.36				0.22			
		CPF	1.86	5.07	0.41	0.36				0.14				0.17			
		SCCC	0.83	2.53	0.37	0.32				0.35				0.61			

[illegible]

[illegible]

สัปดาห์	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		GOLD	0.42	0.68	0.16	0.55	1.13	0.65	1.67	0.50	1.13	0.32	3.35		1.38	2.81	0.47
		EGCOMP	2.15	2.02	-0.54	1.04				0.30				0.01			
		BECL	1.37	2.86	0.74	0.46				0.19				0.99			
204	26 พ.ย. 47	SET Index	0.59	2.19	1.00	0.25											
		GOLD	-0.71	0.86	0.19	-0.88	1.31	0.91	1.39	0.21	1.31	0.43	2.96		1.59	2.74	0.57
		SCCC	2.18	1.77	0.43	1.21				0.33				0.01			
		BECL	1.64	2.39	-0.04	0.67				0.20				0.01			
		EGCOMP	1.59	2.82	-0.14	0.55				0.26				0.98			
209	30 ธ.ค. 47	SET Index	0.93	2.05	1.00	0.43											
		GOLD	-0.97	1.24	-0.45	-0.82	1.38	2.76	0.48	0.01	1.38	1.59	0.84		1.38	1.58	0.84
		EGCOMP	2.10	2.80	1.25	0.74				0.29				0.27			
		BANPU	1.91	3.04	1.34	0.61				0.14				0.14			
		SCCC	1.84	3.18	1.25	0.56				0.17				0.17			
		HANA	0.51	0.88	-0.04	0.52				0.39				0.41			

หมายเหตุ N/A คือไม่สามารถคำนวณข้อมูลได้

ตารางภาคผนวกที่ 11

ตัวอย่างการคำนวณสัดส่วนการลงทุนในทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ ใน Portfolio
ในปี พ.ศ. 2548 – พ.ศ. 2551 ณ สัปดาห์สุดท้ายของทุกเดือน

สัปดาห์	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
4	28 ม.ค. 48	SET Index	1.21	0.84	1.00	1.39											
		GOLD	0.41	1.86	-1.56	0.19	2.21	1.34	1.61	0.01	2.21	0.42	5.09		2.21	0.42	5.12
		BANPU	0.47	0.26	0.05	1.61				0.12				0.13			
		PTTEP	2.16	1.94	-0.86	1.09				0.41				0.41			
		PSL	4.96	5.01	3.23	0.98				0.12				0.12			
		SCIB	1.93	2.43	0.69	0.77				0.34				0.33			
8	25 ก.พ. 48	SET Index	-1.39	1.59	1.00	-0.90											
		GOLD	0.13	1.42	0.22	0.06	-0.60	2.02	-0.32	0.01	-0.60	0.73	-0.89		-0.60	0.73	-0.89
		SCCC	-0.14	1.37	0.41	-0.13				0.59				0.61			
		BECL	-0.70	2.37	0.79	-0.32				0.15				0.15			
		PSL	-1.31	3.81	-0.23	-0.36				0.03				0.03			
		ADVANC	-1.59	4.12	0.47	-0.40				0.04				0.04			
		HANA	-1.80	4.58	-0.01	-0.40				0.17				0.17			
12	25 มี.ค. 48	SET Index	-0.67	2.56	1.00	-0.28											
		GOLD	0.07	1.31	-0.17	0.01	0.28	1.86	0.12	0.31	0.28	1.85	0.12		0.28	3.85	0.06
		PTTEP	0.49	5.12	-0.04	0.09				0.31				0.03			

สัปดาห์	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		TMB	0.27	4.00	0.36	0.05				0.38				0.97			
17	29 เม.ย. 48	SET Index	0.14	3.93	1.00	0.02											
		GOLD	-1.02	1.46	-0.36	-0.73	1.17	1.62	0.69	0.24	1.17	0.00	N/A	0.20	1.17	0.79	1.41
		BAY	2.18	2.63	0.35	0.81				0.43				0.62			
		SCCC	0.72	1.25	0.31	0.53				0.06				0.01			
		KTB	1.96	4.86	1.00	0.39				0.06				0.01			
		TRUE	2.31	8.53	2.13	0.26				0.01				0.01			
		PTTEP	1.60	6.81	-0.97	0.23				0.17				0.14			
		EGCOMP	0.70	3.03	0.01	0.21				0.04				0.01			
21	27 พ.ค. 48	SET Index	0.58	1.10	1.00	0.48											
		GOLD	1.64	1.98	0.36	0.80	2.67	1.00	2.62	0.26	2.67	0.85	3.09		2.67	0.99	2.64
		RATCH	0.89	0.57	-0.18	1.47				0.22				0.39			
		TRUE	4.70	3.31	0.72	1.40				0.26				0.25			
		PTTEP	3.19	2.33	0.33	1.35				0.26				0.35			
26	30 มิ.ย. 48	SET Index	-0.38	3.47	1.00	-0.13											
		GOLD	-0.22	1.52	0.03	-0.19	1.10	1.28	0.81	0.01	1.10	0.89	1.18		1.10	0.88	1.19
		HANA	1.41	1.67	0.05	0.81				0.37				0.37			
		PTTEP	2.60	3.73	0.99	0.68				0.10				0.10			
		RATCH	0.61	0.97	0.02	0.57				0.52				0.53			
30	29 ก.ค. 48	SET Index	1.42	1.90	1.00	0.71											
		GOLD	0.16	0.83	-0.01	0.12	2.35	2.14	1.07	0.32	2.35	1.73	1.32		2.35	1.89	1.21

ลำดับ	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		PTTEP	4.55	4.41	1.91	1.02				0.34				0.07			
		KBANK	2.17	3.05	1.28	0.69				0.04				0.47			
		BANPU	2.26	3.42	1.13	0.64				0.06				0.01			
		PSL	2.18	3.46	0.32	0.61				0.25				0.44			
34	26 ส.ค. 48	SET Index	1.28	1.34	1.00	0.91											
		GOLD	0.93	1.24	-0.41	0.69	2.06	1.63	1.23	0.33	2.06	0.95	2.10		2.62	1.58	1.62
		AOT	2.62	2.61	0.10	0.98				0.32				0.50			
		BAY	2.62	3.20	2.01	0.80				0.35				0.50			
39	30 ก.ย. 48	SET Index	-1.21	0.78	1.00	-1.66											
		GOLD	0.23	1.60	1.77	0.09	0.59	1.27	0.41	0.13	0.59	1.13	0.46		0.59	1.24	0.42
		BEC	1.01	3.77	-1.39	0.25				0.17				0.07			
		TPC	0.54	2.05	1.10	0.23				0.47				0.62			
		SCCC	0.60	3.02	-1.82	0.17				0.24				0.31			
43	28 ต.ค. 48	SET Index	-0.46	2.33	1.00	-0.23											
		GOLD	1.58	2.18	-0.85	0.69	1.07	0.63	1.57	0.08	1.07	0.48	2.05		1.07	0.51	1.95
		EGCOMP	1.24	2.18	-0.81	0.53				0.45				0.55			
		RATCH	0.52	1.24	0.20	0.36				0.13				0.08			
		SCC	0.93	3.19	1.35	0.27				0.34				0.37			
47	25 พ.ย. 48	SET Index	0.69	2.99	1.00	0.20											
		GOLD	0.61	3.24	0.57	0.16	1.99	2.29	0.83	0.22	1.99	1.97	0.97		1.99	2.22	0.86
		BAY	2.88	3.02	0.41	0.93				0.47				0.34			

สัปดาห์	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		TRUE	3.64	6.16	1.75	0.58				0.01				0.02			
		SCC	1.39	2.60	0.70	0.50				0.14				0.49			
		SCCC	1.72	3.35	0.09	0.49				0.16				0.15			
52	30 ธ.ค. 48	SET Index	1.74	2.07	1.00	0.80											
		GOLD	1.25	1.56	-0.10	0.75	3.11	2.46	1.23	0.01	3.11	0.93	3.26		3.11	0.92	3.29
		SCCC	2.90	1.15	0.22	2.45				0.74				0.77			
		TRUE	3.94	3.28	1.15	1.17				0.17				0.15			
		PTTEP	3.53	3.73	0.95	0.92				0.07				0.08			
56	27 ม.ค. 49	SET Index	-0.15	1.44	1.00	-0.16											
		GOLD	-0.33	1.93	-0.44	-0.22	0.90	0.69	1.18	0.16	0.90	0.57	1.43		0.90	0.80	1.02
		BAY	1.59	1.84	0.89	0.82				0.22				0.01			
		SCB	1.21	1.58	0.90	0.71				0.22				0.38			
		TPC	0.63	1.17	0.26	0.46				0.30				0.56			
		BANPU	1.40	4.55	-1.15	0.29				0.11				0.05			
60	24 ก.พ. 49	SET Index	-0.21	2.17	1.00	-0.14											
		GOLD	0.13	2.97	1.16	0.01	1.44	1.53	0.88	0.44	1.44	0.82	1.64		2.46	2.79	0.85
		THAI	2.46	2.79	-0.75	0.85				0.56				1.00			
65	31 มี.ค. 49	SET Index	1.03	2.73	1.00	0.34											
		GOLD	2.10	1.65	-0.20	1.22	2.63	0.67	3.79	0.45	2.63	0.49	5.18		2.63	1.14	2.22
		BAY	1.72	2.86	0.04	0.57				0.09				0.45			
		AOT	3.66	6.47	0.39	0.55				0.21				0.30			

สัปดาห์	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		BEC	3.03	5.44	0.68	0.54				0.25				0.25			
69	28 เม.ย. 49	SET Index	0.41	1.29	1.00	0.24											
		GOLD	4.70	2.02	1.28	2.28	4.38	1.53	2.80	0.50	4.38	1.10	3.88		4.38	2.60	1.65
		TTA	2.45	2.13	1.24	1.11				0.30				0.53			
		AOT	6.54	7.23	-1.09	0.89				0.20				0.47			
73	26 พ.ค. 49	SET Index	-3.46	3.98	1.00	-0.89											
		GOLD	-1.65	0.29	0.06	-6.12	-0.63	1.69	-0.43	0.47	-0.63	0.78	-0.93		0.29	1.29	0.15
		PSL	0.29	1.29	0.32	0.15				0.53				1.00			
78	30 มิ.ย. 49	SET Index	0.98	2.80	1.00	0.31											
		GOLD	1.67	3.98	-0.80	0.39	2.06	0.78	2.52	0.34	2.06	0.62	3.19		2.06	1.70	1.15
		TTA	3.56	3.74	1.01	0.92				0.26				0.26			
		PTT	1.61	1.94	0.58	0.78				0.06				0.44			
		AOT	1.42	1.94	0.16	0.68				0.34				0.30			
82	28 ก.ค. 49	SET Index	0.11	1.70	1.00	0.01											
		GOLD	-0.54	2.82	-0.13	-0.23	1.83	1.87	0.93	0.20	1.83	0.61	2.85		2.34	2.86	0.79
		SCIB	2.44	1.15	-0.24	2.04				0.60				0.01			
		BEC	2.34	2.89	0.50	0.78				0.20				0.99			
86	25 ส.ค. 49	SET Index	-0.75	1.92	1.00	-0.44											
		GOLD	-0.84	3.60	-1.50	-0.26	1.67	1.96	0.80	0.13	1.67	0.46	3.39		1.72	1.49	1.09
		THAI	2.81	2.56	0.44	1.06				0.25				0.01			
		HANA	1.70	1.57	0.16	1.02				0.59				0.97			

[illegible]

ลำดับ	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		GOLD	1.49	1.43	0.27	0.98	2.09	1.47	1.36	0.49	2.09	0.89	2.25		2.28	3.19	0.69
		TPIPL	2.38	3.17	-0.43	0.72				0.23				0.01			
		TRUE	5.15	7.39	1.72	0.68				0.06				0.01			
		SCB	2.25	3.23	0.77	0.67				0.22				0.98			
112	23 ก.พ. 50	SET Index	-0.29	1.11	1.00	-0.34											
		GOLD	-0.62	2.96	2.10	-0.24	0.92	1.71	0.49	0.01	0.92	1.07	0.78		0.92	1.04	0.80
		BANPU	2.19	2.05	1.65	1.03				0.09				0.08			
		AOT	1.18	1.63	1.05	0.67				0.31				0.31			
		SCB	1.03	2.14	1.31	0.45				0.14				0.14			
		TPC	0.47	1.12	0.52	0.35				0.45				0.46			
117	30 มี.ค. 50	SET Index	0.51	1.46	1.00	0.30											
		GOLD	0.52	1.44	-0.11	0.31	1.40	0.66	2.02	0.01	1.40	0.25	5.29		1.40	0.24	5.59
		BANPU	2.20	3.53	1.76	0.60				0.27				0.28			
		TMB	0.80	1.33	-0.57	0.55				0.23				0.24			
		TTA	2.62	4.89	1.15	0.52				0.07				0.06			
		SCCC	1.06	2.08	-0.76	0.47				0.36				0.36			
		PTT	0.97	2.12	0.04	0.42				0.06				0.06			
121	27 เม.ย. 50	SET Index	0.92	2.21	1.00	0.39											
		GOLD	-1.17	1.88	0.41	-0.66	2.35	2.87	0.80	0.01	2.35	0.91	2.51		2.35	0.89	2.58
		ITD	3.47	5.39	1.18	0.63				0.31				0.34			
		PTTEP	2.21	4.25	1.43	0.50				0.11				0.12			

สัปดาห์	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		TTA	3.15	6.35	1.16	0.49				0.06				0.01			
		TPIPL	1.14	3.79	0.71	0.28				0.07				0.09			
		PSL	2.02	7.51	-0.18	0.26				0.07				0.09			
		TMB	1.71	6.89	-1.11	0.24				0.36				0.36			
125	25 พ.ค. 50	SET Index	1.19	2.88	1.00	0.39											
		GOLD	-0.13	1.19	0.28	-0.16	2.24	3.02	0.72	0.01	2.24	1.93	1.13		2.24	1.89	1.15
		SCC	1.64	1.01	0.28	1.57				0.76				0.78			
		TMB	5.68	12.33	2.23	0.46				0.13				0.12			
		BANPU	2.63	6.58	1.24	0.39				0.10				0.09			
130	29 มิ.ย. 50	SET Index	2.30	3.11	1.00	0.72											
		GOLD	-0.25	2.36	-0.40	-0.13	2.99	3.15	0.93	0.19	2.99	2.25	1.30		2.99	2.90	1.01
		PTT	3.94	3.45	1.04	1.12				0.66				0.18			
		ADVANC	2.68	3.66	0.59	0.72				0.03				0.52			
		EGCOMP	2.94	4.07	0.60	0.71				0.11				0.30			
134	27 ก.ค. 50	SET Index	-1.80	2.92	1.00	-0.64											
		GOLD	-0.20	2.41	-0.74	-0.11	0.52	2.50	0.18	0.37	0.52	1.27	0.36		0.52	2.97	0.15
		TTA	2.13	8.26	1.78	0.25				0.30				0.29			
		BANPU	-0.14	5.35	0.39	-0.04				0.34				0.71			
139	31 ส.ค. 50	SET Index	1.36	1.68	1.00	0.77											
		GOLD	2.31	1.24	-0.57	1.81	3.37	0.68	4.83	0.23	3.37	0.58	5.67		3.37	1.03	3.22
		PTT	3.00	1.71	0.49	1.72				0.47				0.79			

ลำดับ	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		BANPU	4.79	3.59	0.59	1.32				0.30				0.21			
143	28 ก.ย. 50	SET Index	1.49	1.95	1.00	0.73											
		GOLD	1.05	1.17	0.07	0.84	3.32	2.98	1.09	0.01	3.32	2.75	1.18		3.32	2.75	1.18
		PTT	4.30	4.85	0.75	0.87				0.41				0.42			
		BANPU	6.26	7.33	3.41	0.85				0.12				0.12			
		SCB	1.66	2.33	0.78	0.68				0.45				0.46			
147	26 ต.ค. 50	SET Index	-0.03	2.17	1.00	-0.04											
		GOLD	2.65	1.27	-0.50	2.03	2.21	1.20	1.78	0.59	2.21	0.00	N/A		2.21	1.52	1.41
		BEC	2.40	2.87	-0.37	0.81				0.06				0.57			
		BAY	1.23	1.88	0.63	0.62				0.29				0.19			
		PTT	2.57	6.16	2.45	0.41				0.05				0.23			
152	30 พ.ย. 50	SET Index	0.85	3.23	1.00	0.24											
		GOLD	0.39	2.86	-0.11	0.11	1.38	1.16	1.14	0.08	1.38	1.05	1.26		1.38	1.07	1.23
		PSL	2.47	3.89	0.67	0.62				0.21				0.18			
		TPC	0.83	1.34	0.34	0.57				0.44				0.53			
		THAI	1.35	2.26	0.31	0.56				0.08				0.08			
		BEC	1.89	3.56	-0.16	0.51				0.20				0.21			
156	28 ธ.ค. 50	SET Index	-1.30	4.00	1.00	-0.34											
		GOLD	2.15	2.13	-0.05	0.98	2.15	2.13	0.98	1.00	1.08	1.06	0.95				
160	25 ม.ค. 51	SET Index	0.99	3.92	1.00	0.24											
		GOLD	0.91	2.42	-0.48	0.35	2.36	0.67	3.45	0.49	2.36	0.52	4.43		2.36	1.43	1.61

[illegible]

[illegible]

สัปดาห์	วันที่	หลักทรัพย์	Return (%)	Risk (Stdv)	Beta	Sharpe's Index	Portfolio Return (%)	Portfolio Risk	Sharpe's Index	ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ				ไม่ลงทุนทองคำร่วมกับหลักทรัพย์อื่นๆ			
										น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index	น้ำหนัก	Portfolio Return	Portfolio Risk	Sharpe's Index
		GOLD	1.51	4.14	0.48	0.35	5.76	2.61	2.19	0.09	5.76	1.93	2.96		5.76	2.15	2.66
		EGCOMP	5.27	2.44	0.18	2.14				0.70				0.87			
		RATCH	9.18	5.22	1.06	1.75				0.21				0.13			
207	19 ธ.ค. 51	SET Index	0.93	6.17	1.00	0.14											
		GOLD	2.04	4.33	0.07	0.46	3.96	3.67	1.06	0.40	3.96	3.53	1.11		4.01	5.81	0.68
		RATCH	7.23	8.02	1.21	0.90				0.23				0.01			
		BECL	3.98	5.83	0.67	0.67				0.36				0.99			

หมายเหตุ N/A คือไม่สามารถคำนวณผลข้อมูลได้