



ภาคผนวก

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

ภาคผนวก ก

ตารางแสดง MacKinnon Critical Values for Unit Root test

ระดับ Level

Lag 4

Critical Value (%)	without C & T	with C & without T	with C & T
1%	-2.5723	-3.4534	-3.9914
5%	-1.9406	-2.8711	-3.4259
10%	-1.6162	-2.5718	-3.1358

Lag 3

Critical Value (%)	without C & T	with C & without T	with C & T
1%	-2.5722	-3.4533	-3.9913
5%	-1.9406	-2.8710	-3.4259
10%	-1.6162	-2.5718	-3.1358

Lag 2

Critical Value (%)	without C & T	with C & without T	with C & T
1%	-2.5722	-3.4533	-3.9912
5%	-1.9406	-2.8710	-3.4258
10%	-1.6162	-2.5718	-3.1358

Lag 1

Critical Value (%)	without C & T	with C & without T	with C & T
1%	-2.5722	-3.4532	-3.9911
5%	-1.9406	-2.8710	-3.4258
10%	-1.6162	-2.5718	-3.1358

Lag 0

Critical Value (%)	without C & T	with C & without T	with C & T
1%	-2.5722	-3.4531	-3.9911
5%	-1.9406	-2.8710	-3.4257
10%	-1.6162	-2.5718	-3.1357

ที่มา : MacKinnon, J. G. (1991)

ระดับ first differenceLag 4

Critical Value (%)	without C & T	with C & without T	with C & T
1%	-2.5723	-3.4535	-3.9915
5%	-1.9406	-2.8711	-3.4259
10%	-1.6162	-2.5718	-3.1359

Lag 3

Critical Value (%)	without C & T	with C & without T	with C & T
1%	-2.5723	-3.4534	-3.9914
5%	-1.9406	-2.8711	-3.4259
10%	-1.6162	-2.5718	-3.1358

Lag 2

Critical Value (%)	without C & T	with C & without T	with C & T
1%	-2.5722	-3.4533	-3.9913
5%	-1.9406	-2.8710	-3.4259
10%	-1.6162	-2.5718	-3.1358

Lag 1

Critical Value (%)	without C & T	with C & without T	with C & T
1%	-2.5722	-3.4533	-3.9912
5%	-1.9406	-2.8710	-3.4258
10%	-1.6162	-2.5718	-3.1358

Lag 0

Critical Value (%)	without C & T	with C & without T	with C & T
1%	-2.5722	-3.4532	-3.9911
5%	-1.9406	-2.8710	-3.4258
10%	-1.6162	-2.5718	-3.1358

ที่มา : MacKinnon, J. G. (1991)

All rights reserved

ภาคผนวก ข

ผลการทดสอบการรวมกันไปด้วยกัน (Cointegration)

บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)

ราคาหลักทรัพย์

Dependent Variable: PRICE
Method: Least Squares
Date: 04/11/05 Time: 22:33
Sample: 1 313
Included observations: 313

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.534920	0.078615	6.804330	0.0000
VOLUME	0.240195	0.016762	14.32995	0.0000
R-squared	0.397692	Mean dependent var		1.656748
Adjusted R-squared	0.395756	S.D. dependent var		0.163563
S.E. of regression	0.127143	Akaike info criterion		-1.280647
Sum squared resid	5.027385	Schwarz criterion		-1.256709
Log likelihood	202.4212	F-statistic		205.3475
Durbin-Watson stat	0.423199	Prob(F-statistic)		0.000000

ที่มา : จากการค้าจำนวน

ปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์

Dependent Variable: VOLUME
Method: Least Squares
Date: 04/11/05 Time: 22:31
Sample: 1 313
Included observations: 313

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	1.927399	0.192351	10.02021	0.0000
PRICE	1.655707	0.115542	14.32995	0.0000
R-squared	0.397692	Mean dependent var		4.670488
Adjusted R-squared	0.395756	S.D. dependent var		0.429432
S.E. of regression	0.333811	Akaike info criterion		0.649886
Sum squared resid	34.65467	Schwarz criterion		0.673823
Log likelihood	-99.70712	F-statistic		205.3475
Durbin-Watson stat	0.998550	Prob(F-statistic)		0.000000

ที่มา : จากการค้าจำนวน

บริษัท ชิน คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)

ราคาหลักทรัพย์

Dependent Variable: PRICE
 Method: Least Squares
 Date: 04/11/05 Time: 22:16
 Sample: 1 313
 Included observations: 313

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.447915	0.101469	4.414305	0.0000
VOLUME	0.159639	0.019729	8.091644	0.0000
R-squared	0.173915	Mean dependent var		1.265305
Adjusted R-squared	0.171259	S.D. dependent var		0.186028
S.E. of regression	0.169351	Akaike info criterion		-0.707319
Sum squared resid	8.919391	Schwarz criterion		-0.683382
Log likelihood	112.6954	F-statistic		65.47471
Durbin-Watson stat	0.102787	Prob(F-statistic)		0.000000

ที่มา : จากถาวรคำนวณ

ปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์

Dependent Variable: VOLUME
 Method: Least Squares
 Date: 04/11/05 Time: 22:35
 Sample: 1 313
 Included observations: 313

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	3.741785	0.172182	21.73161	0.0000
PRICE	1.089430	0.134636	8.091644	0.0000
R-squared	0.173915	Mean dependent var		5.120246
Adjusted R-squared	0.171259	S.D. dependent var		0.485969
S.E. of regression	0.442403	Akaike info criterion		1.213178
Sum squared resid	60.86904	Schwarz criterion		1.237115
Log likelihood	-187.8624	F-statistic		65.47471
Durbin-Watson stat	0.533340	Prob(F-statistic)		0.000000

ที่มา : จากถาวรคำนวณ

บริษัท ยูไนเต็ดคอมมูนิเคชั่น อินดัสตรี จำกัด (มหาชน)

ราคาหลักทรัพย์

Dependent Variable: PRICE
 Method: Least Squares
 Date: 04/11/05 Time: 22:54
 Sample: 1 313
 Included observations: 313

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.813002	0.080587	10.08855	0.0000
VOLUME	0.129138	0.017151	7.529343	0.0000
R-squared	0.154181	Mean dependent var		1.414789
Adjusted R-squared	0.151461	S.D. dependent var		0.197827
S.E. of regression	0.182231	Akaike info criterion		-0.560713
Sum squared resid	10.32774	Schwarz criterion		-0.536776
Log likelihood	89.75164	F-statistic		56.69101
Durbin-Watson stat	0.071102	Prob(F-statistic)		0.000000

ที่มา : จากการคำนวณ

ปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์

Dependent Variable: VOLUME
 Method: Least Squares
 Date: 04/11/05 Time: 22:40
 Sample: 1 313
 Included observations: 313

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	2.970876	0.226518	13.11542	0.0000
PRICE	1.193923	0.158569	7.529343	0.0000
R-squared	0.154181	Mean dependent var		4.660025
Adjusted R-squared	0.151461	S.D. dependent var		0.601516
S.E. of regression	0.554094	Akaike info criterion		1.663404
Sum squared resid	95.48319	Schwarz criterion		1.687341
Log likelihood	-258.3227	F-statistic		56.69101
Durbin-Watson stat	0.345461	Prob(F-statistic)		0.000000

ที่มา : จากการคำนวณ

บริษัท ทรู คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)

ราคาหลักทรัพย์

Dependent Variable: PRICE

Method: Least Squares

Date: 04/11/05 Time: 23:35

Sample: 1 309

Included observations: 309

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	2.606706	0.140668	18.53088	0.0000
VOLUME	-0.286191	0.026654	-10.73739	0.0000
R-squared	0.273014	Mean dependent var		1.106844
Adjusted R-squared	0.270646	S.D. dependent var		0.341588
S.E. of regression	0.291723	Akaike info criterion		0.380430
Sum squared resid	26.12647	Schwarz criterion		0.404594
Log likelihood	-56.77637	F-statistic		115.2916
Durbin-Watson stat	0.129846	Prob(F-statistic)		0.000000

ที่มา : จากการคำนวณ

ปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์

Dependent Variable: VOLUME

Method: Least Squares

Date: 04/11/05 Time: 23:15

Sample: 1 309

Included observations: 309

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	6.296652	0.102899	61.19259	0.0000
PRICE	-0.953958	0.088844	-10.73739	0.0000
R-squared	0.273014	Mean dependent var		5.240769
Adjusted R-squared	0.270646	S.D. dependent var		0.623646
S.E. of regression	0.532608	Akaike info criterion		1.584389
Sum squared resid	87.08706	Schwarz criterion		1.608553
Log likelihood	-242.7881	F-statistic		115.2916
Durbin-Watson stat	0.367337	Prob(F-statistic)		0.000000

ที่มา : จากการคำนวณ

บริษัท ทีทีแอนด์ที จำกัด (มหาชน)

ราคาหลักทรัพย์

Dependent Variable: PRICE
 Method: Least Squares
 Date: 04/11/05 Time: 23:53
 Sample: 1 313
 Included observations: 313

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.438296	0.102187	4.289141	0.0000
VOLUME	0.040453	0.018424	2.195674	0.0289
R-squared	0.015265	Mean dependent var		0.661280
Adjusted R-squared	0.012099	S.D. dependent var		0.201929
S.E. of regression	0.200704	Akaike info criterion		-0.367602
Sum squared resid	12.52773	Schwarz criterion		-0.343665
Log likelihood	59.52976	F-statistic		4.820983
Durbin-Watson stat	0.032697	Prob(F-statistic)		0.028854

ที่มา : จากการคำนวณ

ปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์

Dependent Variable: VOLUME
 Method: Least Squares
 Date: 04/11/05 Time: 23:45
 Sample: 1 313
 Included observations: 313

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	5.262562	0.118811	44.29365	0.0000
PRICE	0.377345	0.171858	2.195674	0.0289
R-squared	0.015265	Mean dependent var		5.512093
Adjusted R-squared	0.012099	S.D. dependent var		0.616724
S.E. of regression	0.612982	Akaike info criterion		1.865405
Sum squared resid	116.8571	Schwarz criterion		1.889343
Log likelihood	-289.9359	F-statistic		4.820983
Durbin-Watson stat	0.398853	Prob(F-statistic)		0.028854

ที่มา : จากการคำนวณ

บริษัท ชินแซทเทลไลท์ จำกัด (มหาชน)

ราคาหลักทรัพย์

Dependent Variable: PRICE
 Method: Least Squares
 Date: 04/12/05 Time: 00:26
 Sample: 1 313
 Included observations: 313

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	1.059483	0.058864	17.99884	0.0000
VOLUME	0.009004	0.011397	0.790029	0.4301
R-squared	0.002003	Mean dependent var		1.105663
Adjusted R-squared	-0.001206	S.D. dependent var		0.122664
S.E. of regression	0.122738	Akaike info criterion		-1.351158
Sum squared resid	4.685108	Schwarz criterion		-1.327220
Log likelihood	213.4562	F-statistic		0.624146
Durbin-Watson stat	0.061745	Prob(F-statistic)		0.430113

ที่มา : จากการคำนวณ

ปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์

Dependent Variable: VOLUME
 Method: Least Squares
 Date: 04/12/05 Time: 00:17
 Sample: 1 313
 Included observations: 313

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	4.882882	0.313217	15.58944	0.0000
PRICE	0.222443	0.281563	0.790029	0.4301
R-squared	0.002003	Mean dependent var		5.128829
Adjusted R-squared	-0.001206	S.D. dependent var		0.609689
S.E. of regression	0.610057	Akaike info criterion		1.855840
Sum squared resid	115.7447	Schwarz criterion		1.879777
Log likelihood	-288.4389	F-statistic		0.624146
Durbin-Watson stat	0.406975	Prob(F-statistic)		0.430113

ที่มา : จากการคำนวณ

ภาคผนวก ค

ผลการทดสอบความนิ่งของส่วนที่เหลือ (Residual) จากสมการถดถอยในการทดสอบ
การร่วมกันไปด้วยกัน โดยการทดสอบยูนิทรูท ด้วยวิธีการ ADF

บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)

ราคาหลักทรัพย์

ADF Test Statistic	-6.095301	1% Critical Value*	-2.5722
		5% Critical Value	-1.9406
		10% Critical Value	-1.6162

*MacKinnon critical values for rejection of hypothesis of a unit root.

ที่มา : จากการคำนวณ

ปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์

ADF Test Statistic	-10.17526	1% Critical Value*	-2.5722
		5% Critical Value	-1.9406
		10% Critical Value	-1.6162

*MacKinnon critical values for rejection of hypothesis of a unit root.

ที่มา : จากการคำนวณ

บริษัท ชิน คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)

ราคาหลักทรัพย์

ADF Test Statistic	-2.901809	1% Critical Value*	-2.5722
		5% Critical Value	-1.9406
		10% Critical Value	-1.6162

*MacKinnon critical values for rejection of hypothesis of a unit root.

ที่มา : จากการคำนวณ

ปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์

ADF Test Statistic	-7.009465	1% Critical Value*	-2.5722
		5% Critical Value	-1.9406
		10% Critical Value	-1.6162

*MacKinnon critical values for rejection of hypothesis of a unit root.

ที่มา : จากการคำนวณ

บริษัท ยูไนเต็ดคอมมูนิเคชั่น อินคัสตรี จำกัด (มหาชน)

ราคาหลักทรัพย์

ADF Test Statistic	-2.046996	1% Critical Value*	-2.5722
		5% Critical Value	-1.9406
		10% Critical Value	-1.6162

*MacKinnon critical values for rejection of hypothesis of a unit root.

ที่มา : จากการคำนวณ

ปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์

ADF Test Statistic	-5.493157	1% Critical Value*	-2.5722
		5% Critical Value	-1.9406
		10% Critical Value	-1.6162

*MacKinnon critical values for rejection of hypothesis of a unit root.

ที่มา : จากการคำนวณ

บริษัท ทู คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)

ราคาหลักทรัพย์

ADF Test Statistic	-3.184460	1% Critical Value*	-2.5723
		5% Critical Value	-1.9406
		10% Critical Value	-1.6162

*MacKinnon critical values for rejection of hypothesis of a unit root.

ที่มา : จากการคำนวณ

ปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์

ADF Test Statistic	-5.393958	1% Critical Value*	-2.5723
		5% Critical Value	-1.9406
		10% Critical Value	-1.6162

*MacKinnon critical values for rejection of hypothesis of a unit root.

ที่มา : จากการคำนวณ

บริษัท ทีทีแอนด์ที จำกัด (มหาชน)

ราคาหลักทรัพย์

ADF Test Statistic	-1.625161	1% Critical Value*	-2.5722
		5% Critical Value	-1.9406
		10% Critical Value	-1.6162

*MacKinnon critical values for rejection of hypothesis of a unit root.

ที่มา : จากการคำนวณ

ปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์

ADF Test Statistic	-5.747920	1% Critical Value*	-2.5722
		5% Critical Value	-1.9406
		10% Critical Value	-1.6162

*MacKinnon critical values for rejection of hypothesis of a unit root.

ที่มา : จากการคำนวณ

บริษัท ชินเซทเทคโนโลยี จำกัด (มหาชน)

ราคาหลักทรัพย์

ADF Test Statistic	-2.267711	1% Critical Value*	-2.5722
		5% Critical Value	-1.9406
		10% Critical Value	-1.6162

*MacKinnon critical values for rejection of hypothesis of a unit root.

ที่มา : จากการคำนวณ

ปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์

ADF Test Statistic	-5.992509	1% Critical Value*	-2.5722
		5% Critical Value	-1.9406
		10% Critical Value	-1.6162

*MacKinnon critical values for rejection of hypothesis of a unit root.

ที่มา : จากการคำนวณ

ภาคผนวก ง

ผลการประมาณค่าสัมประสิทธิ์ โดยใช้ Error-Correction Model (ECM)

บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)

ราคาหลักทรัพย์

Dependent Variable: D(PRICE)

Method: Least Squares

Date: 04/21/05 Time: 00:30

Sample(adjusted): 5 313

Included observations: 309 after adjusting endpoints

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.002145	0.001221	1.757346	0.0799
D(VOLUME(-1))	-0.001915	0.003900	-0.491065	0.6237
D(PRICE(-1))	-0.089639	0.057067	-1.570776	0.1173
D(PRICE(-3))	0.049067	0.055702	0.880874	0.3791
RESID01(-1)	-0.018302	0.010391	-1.761348	0.0792
R-squared	0.021948	Mean dependent var		0.002028
Adjusted R-squared	0.009079	S.D. dependent var		0.021341
S.E. of regression	0.021244	Akaike info criterion		-4.849415
Sum squared resid	0.137200	Schwarz criterion		-4.789005
Log likelihood	754.2346	F-statistic		1.705518
Durbin-Watson stat	1.997029	Prob(F-statistic)		0.148624

ที่มา : จากการคำนวณ

ปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์

Dependent Variable: D(VOLUME)

Method: Least Squares

Date: 04/21/05 Time: 00:04

Sample(adjusted): 5 313

Included observations: 309 after adjusting endpoints

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.001737	0.014988	0.115891	0.9078
D(PRICE(-1))	-0.445538	0.701403	-0.635210	0.5258
D(VOLUME(-1))	-0.490426	0.069861	-7.020023	0.0000
D(VOLUME(-2))	-0.384096	0.066641	-5.763652	0.0000
D(VOLUME(-3))	-0.126632	0.056060	-2.258859	0.0246
RESID01(-1)	-0.239852	0.057978	-4.136947	0.0000
R-squared	0.368874	Mean dependent var		0.000988
Adjusted R-squared	0.358460	S.D. dependent var		0.327290
S.E. of regression	0.262147	Akaike info criterion		0.179406
Sum squared resid	20.82252	Schwarz criterion		0.251898
Log likelihood	-21.71820	F-statistic		35.41890
Durbin-Watson stat	2.019532	Prob(F-statistic)		0.000000

ที่มา : จากการคำนวณ

บริษัท ชิน คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)

ราคาหลักทรัพย์

Dependent Variable: D(PRICE)

Method: Least Squares

Date: 04/18/05 Time: 22:58

Sample(adjusted): 4 313

Included observations: 310 after adjusting endpoints

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.001789	0.001488	1.202684	0.2300
D(VOLUME)	0.019795	0.004866	4.068120	0.0001
D(VOLUME(-1))	0.017486	0.004903	3.566250	0.0004
D(PRICE(-2))	0.155633	0.053076	2.932263	0.0036
RESID01(-1)	-0.021337	0.009038	-2.360885	0.0189
R-squared	0.107184	Mean dependent var		0.002203
Adjusted R-squared	0.095475	S.D. dependent var		0.027434
S.E. of regression	0.026091	Akaike info criterion		-4.438419
Sum squared resid	0.207633	Schwarz criterion		-4.378152
Log likelihood	692.9550	F-statistic		9.153919
Durbin-Watson stat	2.147641	Prob(F-statistic)		0.000001

ที่มา : จากการคำนวณ

ปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์

Dependent Variable: D(VOLUME)

Method: Least Squares

Date: 04/18/05 Time: 22:45

Sample(adjusted): 5 313

Included observations: 309 after adjusting endpoints

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.006253	0.016164	-0.386829	0.6992
D(PRICE)	3.008546	0.603468	4.985430	0.0000
D(PRICE(-1))	1.250206	0.614001	2.036162	0.0426
D(VOLUME(-1))	-0.298886	0.062236	-4.802444	0.0000
D(VOLUME(-2))	-0.226978	0.060260	-3.766656	0.0002
D(VOLUME(-3))	-0.132097	0.054557	-2.421263	0.0161
RESID01(-1)	-0.179653	0.043403	-4.139162	0.0000
R-squared	0.232149	Mean dependent var		0.002151
Adjusted R-squared	0.216894	S.D. dependent var		0.318672
S.E. of regression	0.282003	Akaike info criterion		0.328596
Sum squared resid	24.01679	Schwarz criterion		0.413170
Log likelihood	-43.76813	F-statistic		15.21761
Durbin-Watson stat	1.997655	Prob(F-statistic)		0.000000

ที่มา : จากการคำนวณ

บริษัท ยูไนเต็ดคอมมูนิเคชั่น อินดัสตรี จำกัด (มหาชน)

ราคาหลักทรัพย์

Dependent Variable: D(PRICE)

Method: Least Squares

Date: 04/18/05 Time: 23:20

Sample(adjusted): 7 313

Included observations: 307 after adjusting endpoints

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.001155	0.002160	0.534425	0.5934
D(VOLUME)	0.041556	0.006634	6.264030	0.0000
D(PRICE(-2))	0.105385	0.053951	1.953350	0.0517
D(PRICE(-5))	0.096334	0.051843	1.858174	0.0641
RESID01(-1)	-0.030332	0.011854	-2.558697	0.0110
R-squared	0.138853	Mean dependent var		0.001657
Adjusted R-squared	0.127447	S.D. dependent var		0.040454
S.E. of regression	0.037788	Akaike info criterion		-3.697499
Sum squared resid	0.431235	Schwarz criterion		-3.636801
Log likelihood	572.5660	F-statistic		12.17376
Durbin-Watson stat	2.127946	Prob(F-statistic)		0.000000

ที่มา : จากการคำนวณ

ปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์

Dependent Variable: D(VOLUME)

Method: Least Squares

Date: 04/18/05 Time: 23:06

Sample(adjusted): 6 313

Included observations: 308 after adjusting endpoints

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.001165	0.016417	0.070959	0.9435
D(PRICE)	3.122243	0.413365	7.553243	0.0000
D(VOLUME(-1))	-0.230857	0.057487	-4.015812	0.0001
D(VOLUME(-2))	-0.171086	0.056471	-3.029632	0.0027
D(VOLUME(-3))	-0.099194	0.055254	-1.795219	0.0736
D(VOLUME(-4))	-0.117551	0.051661	-2.275420	0.0236
RESID01(-1)	-0.110882	0.034364	-3.226722	0.0014
R-squared	0.247334	Mean dependent var		0.004267
Adjusted R-squared	0.232331	S.D. dependent var		0.328519
S.E. of regression	0.287838	Akaike info criterion		0.369624
Sum squared resid	24.93799	Schwarz criterion		0.454399
Log likelihood	-49.92210	F-statistic		16.48529
Durbin-Watson stat	2.045293	Prob(F-statistic)		0.000000

ที่มา : จากการคำนวณ

บริษัท ทู คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)

ราคาหลักทรัพย์

Dependent Variable: D(PRICE)

Method: Least Squares

Date: 04/18/05 Time: 23:40

Sample(adjusted): 5 309

Included observations: 305 after adjusting endpoints

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.001305	0.002179	-0.598756	0.5498
D(VOLUME)	0.028131	0.007092	3.966452	0.0001
D(PRICE(-3))	-0.100705	0.056370	-1.786500	0.0750
RESID01(-1)	0.003428	0.007651	0.447975	0.6545
R-squared	0.058741	Mean dependent var		-0.001065
Adjusted R-squared	0.049359	S.D. dependent var		0.039019
S.E. of regression	0.038044	Akaike info criterion		-3.687142
Sum squared resid	0.435641	Schwarz criterion		-3.638351
Log likelihood	566.2891	F-statistic		6.261438
Durbin-Watson stat	2.056101	Prob(F-statistic)		0.000390

ที่มา : จากการคำนวณ

ปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์

Dependent Variable: D(VOLUME)

Method: Least Squares

Date: 04/18/05 Time: 23:31

Sample(adjusted): 6 309

Included observations: 304 after adjusting endpoints

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.012000	0.015707	0.764013	0.4455
D(PRICE)	1.976893	0.403043	4.904916	0.0000
D(VOLUME(-1))	-0.389522	0.059619	-6.533540	0.0000
D(VOLUME(-2))	-0.234604	0.062044	-3.781234	0.0002
D(VOLUME(-3))	-0.154226	0.060945	-2.530593	0.0119
D(VOLUME(-4))	-0.109973	0.055571	-1.978966	0.0487
RESID01(-1)	-0.094849	0.032831	-2.889036	0.0041
R-squared	0.258091	Mean dependent var		0.005707
Adjusted R-squared	0.243103	S.D. dependent var		0.314177
S.E. of regression	0.273333	Akaike info criterion		0.266507
Sum squared resid	22.18918	Schwarz criterion		0.352096
Log likelihood	-33.50901	F-statistic		17.21975
Durbin-Watson stat	2.059283	Prob(F-statistic)		0.000000

ที่มา : จากการคำนวณ

บริษัท ทีทีแอลที จำกัด (มหาชน)

ราคาหลักทรัพย์

Dependent Variable: D(PRICE)

Method: Least Squares

Date: 04/21/05 Time: 13:55

Sample(adjusted): 4 313

Included observations: 310 after adjusting endpoints

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.000446	0.002043	-0.218322	0.8273
D(VOLUME)	0.041714	0.005325	7.833995	0.0000
D(PRICE(-1))	0.056421	0.052082	1.083298	0.2795
D(PRICE(-2))	0.061970	0.051966	1.192509	0.2340
RESID01(-1)	-0.018266	0.010222	-1.786885	0.0749
R-squared	0.178388	Mean dependent var	-0.000274	
Adjusted R-squared	0.167612	S.D. dependent var	0.039417	
S.E. of regression	0.035962	Akaike info criterion	-3.796699	
Sum squared resid	0.394451	Schwarz criterion	-3.736432	
Log likelihood	593.4883	F-statistic	16.55531	
Durbin-Watson stat	2.128554	Prob(F-statistic)	0.000000	

ที่มา : จากการคำนวณ

ปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์

Dependent Variable: D(VOLUME)

Method: Least Squares

Date: 04/18/05 Time: 23:49

Sample(adjusted): 6 313

Included observations: 308 after adjusting endpoints

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.009976	0.020252	0.492590	0.6227
D(PRICE(-1))	1.648018	0.582591	2.828771	0.0050
D(VOLUME(-1))	-0.357205	0.067380	-5.301321	0.0000
D(VOLUME(-2))	-0.303361	0.063474	-4.779266	0.0000
D(VOLUME(-3))	-0.155075	0.061140	-2.536377	0.0117
D(VOLUME(-4))	-0.138454	0.056341	-2.457443	0.0146
RESID01(-1)	-0.106009	0.038206	-2.774660	0.0059
R-squared	0.189898	Mean dependent var	0.006222	
Adjusted R-squared	0.173750	S.D. dependent var	0.390800	
S.E. of regression	0.355231	Akaike info criterion	0.790367	
Sum squared resid	37.98289	Schwarz criterion	0.875142	
Log likelihood	-114.7166	F-statistic	11.75968	
Durbin-Watson stat	2.003299	Prob(F-statistic)	0.000000	

ที่มา : จากการคำนวณ

บริษัท อินเทอร์เน็ต จำกัด (มหาชน)

ราคาหลักทรัพย์

Dependent Variable: D(PRICE)

Method: Least Squares

Date: 04/19/05 Time: 00:25

Sample(adjusted): 4 313

Included observations: 310 after adjusting endpoints

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.000651	0.001646	0.395287	0.6929
D(VOLUME)	0.022193	0.004658	4.764206	0.0000
D(VOLUME(-1))	0.013460	0.004629	2.907631	0.0039
D(PRICE(-2))	0.111933	0.053391	2.096479	0.0369
RESID01(-1)	-0.025983	0.013626	-1.906839	0.0575
R-squared	0.094031	Mean dependent var		0.000810
Adjusted R-squared	0.082150	S.D. dependent var		0.030227
S.E. of regression	0.028959	Akaike info criterion		-4.229870
Sum squared resid	0.255781	Schwarz criterion		-4.169603
Log likelihood	660.6298	F-statistic		7.914043
Durbin-Watson stat	1.988112	Prob(F-statistic)		0.000004

ที่มา : จากการคำนวณ

ปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์

Dependent Variable: D(VOLUME)

Method: Least Squares

Date: 04/19/05 Time: 00:14

Sample(adjusted): 6 313

Included observations: 308 after adjusting endpoints

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.004496	0.019243	0.233665	0.8154
D(PRICE(-1))	1.777024	0.681490	2.607558	0.0096
D(VOLUME(-1))	-0.479767	0.063329	-7.575734	0.0000
D(VOLUME(-2))	-0.309977	0.065487	-4.733434	0.0000
D(VOLUME(-3))	-0.231512	0.063760	-3.631002	0.0003
D(VOLUME(-4))	-0.161584	0.055604	-2.906006	0.0039
RESID01(-1)	-0.089991	0.035785	-2.514780	0.0124
R-squared	0.246123	Mean dependent var		0.003266
Adjusted R-squared	0.231096	S.D. dependent var		0.384932
S.E. of regression	0.337536	Akaike info criterion		0.688178
Sum squared resid	34.29318	Schwarz criterion		0.772953
Log likelihood	-98.97945	F-statistic		16.37826
Durbin-Watson stat	2.002788	Prob(F-statistic)		0.000000

ที่มา : จากการคำนวณ

ประวัติผู้เขียน

ชื่อ นางสาวสุราณี พลอยงุ่นศรี

วัน เดือน ปี เกิด 18 พฤศจิกายน 2524

ประวัติการศึกษา สำเร็จการศึกษามัธยมศึกษาตอนปลาย โรงเรียนปิ่นสร้อยไขลส์วิทยาลัย
เชียงใหม่ ปีการศึกษา 2543
สำเร็จการศึกษาระดับปริญญาตรีบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ ปีการศึกษา
2547

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University.
All rights reserved