



ภาคผนวก

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

ภาคผนวก

ภาคผนวกที่ 1 แสดงผลการวิเคราะห์การถดถอยอย่างง่ายโดยวิธี CAPM ของหลักทรัพย์ CPN

Dependent Variable: CPN

Method: Least Squares

Date: 02/11/10 Time: 14:58

Sample (adjusted): 5/09/2005 4/27/2009

Included observations: 208 after adjustments

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.005372	0.003674	1.462312	0.1452
SET	1.569248	0.105212	14.91505	0.0000
R-squared	0.519207	Mean dependent var		0.002823
Adjusted R-squared	0.516873	S.D. dependent var		0.076141
S.E. of regression	0.052924	Akaike info criterion		-3.030359
Sum squared resid	0.576991	Schwarz criterion		-2.998267
Log likelihood	317.1573	Hannan-Quinn criter.		-3.017383
F-statistic	222.4588	Durbin-Watson stat		2.097986
Prob(F-statistic)	0.000000			

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright© by Chiang Mai University
 All rights reserved

ภาคผนวกที่ 2 แสดงผลการวิเคราะห์การถดถอยอย่างง่ายโดยวิธี CAPM ของหลักทรัพย์ ITD

Dependent Variable: ITD

Method: Least Squares

Date: 02/11/10 Time: 15:03

Sample (adjusted): 5/09/2005 4/27/2009

Included observations: 208 after adjustments

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.003669	0.003652	-1.004493	0.3163
SET	1.879168	0.104608	17.96391	0.0000
R-squared	0.610367	Mean dependent var		-0.006722
Adjusted R-squared	0.608475	S.D. dependent var		0.084095
S.E. of regression	0.052620	Akaike info criterion		-3.041882
Sum squared resid	0.570381	Schwarz criterion		-3.009790
Log likelihood	318.3557	Hannan-Quinn criter.		-3.028905
F-statistic	322.7021	Durbin-Watson stat		2.225996
Prob(F-statistic)	0.000000			

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright© by Chiang Mai University
 All rights reserved

ภาคผนวกที่ 3 แสดงผลการวิเคราะห์การถดถอยอย่างง่ายโดยวิธี CAPM ของหลักทรัพย์ LH

Dependent Variable: LH

Method: Least Squares

Date: 02/11/10 Time: 15:04

Sample (adjusted): 5/09/2005 4/27/2009

Included observations: 208 after adjustments

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.000865	0.003076	-0.281310	0.7788
SET	1.506969	0.088108	17.10367	0.0000
R-squared	0.586790	Mean dependent var		-0.003314
Adjusted R-squared	0.584784	S.D. dependent var		0.068780
S.E. of regression	0.044320	Akaike info criterion		-3.385195
Sum squared resid	0.404637	Schwarz criterion		-3.353104
Log likelihood	354.0603	Hannan-Quinn criter.		-3.372219
F-statistic	292.5354	Durbin-Watson stat		2.316620
Prob(F-statistic)	0.000000			

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright© by Chiang Mai University
 All rights reserved

ภาคผนวกที่ 4 แสดงผลการวิเคราะห์การถดถอยอย่างง่ายโดยวิธี CAPM ของหลักทรัพย์ QH

Dependent Variable: QH

Method: Least Squares

Date: 02/11/10 Time: 15:05

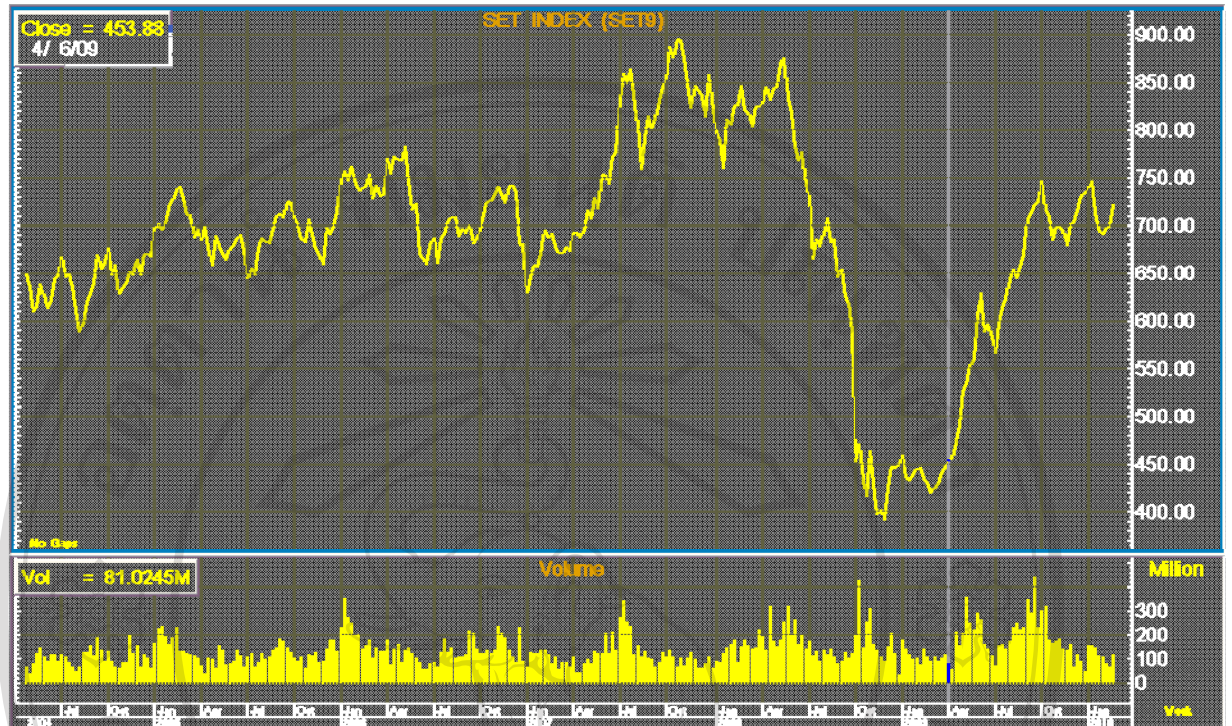
Sample (adjusted): 5/09/2005 4/20/2009

Included observations: 207 after adjustments

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.000604	0.004867	-0.124151	0.9013
SET	-0.077289	0.139427	-0.554331	0.5800
R-squared	0.001497	Mean dependent var		-0.000464
Adjusted R-squared	-0.003374	S.D. dependent var		0.069814
S.E. of regression	0.069932	Akaike info criterion		-2.472973
Sum squared resid	1.002548	Schwarz criterion		-2.440773
Log likelihood	257.9528	Hannan-Quinn criter.		-2.459952
F-statistic	0.307283	Durbin-Watson stat		2.048292
Prob(F-statistic)	0.579957			

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright© by Chiang Mai University
 All rights reserved

ภาคผนวกที่ 5 ดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยระหว่างปี 2547-2552



ที่มา : เอเพ็กซ์บิสนิส

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright© by Chiang Mai University
 All rights reserved

ประวัติผู้เขียน

ชื่อ นายธนกร กล้าณรงค์ชาญ
 วัน เดือน ปี เกิด 4 มกราคม 2525
 ประวัติการศึกษา สำเร็จการศึกษาระดับปริญญาตรี สาขาวิชาบริหารธุรกิจ
 คณะศึกษาศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ ปีการศึกษา 2546



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright© by Chiang Mai University
 All rights reserved