

มหาวิทยาลัยบูรพา
Burapha University

ภาคผนวก

มหาวิทยาลัยบูรพา
Burapha University

ภาคผนวก ก

รายชื่อหลักทรัพย์ที่ใช้ในการวิจัย

ตารางที่ ก-1 แสดงรายชื่อหลักทรัพย์ที่ใช้ในการวิจัยทั้งหมดเรียงตามตัวย่อภาษาอังกฤษ

AA	BCP	CPH	ESTAR	IFEC	LNH	MSC	PATO
ABICO	BEC	CPI	EWC	INET	LOXLEY	NC	PB
ADVANC	BECL	CPL	F&D	INOX	LPN	NCH	PDI
AH	BGH	CPN	FANCY	IT	LRH	NEP	PF
AHC	BH	CSC	FE	ITD	LST	NEW	P-FCB
AI	BIGC	CSL	FMT	ITV	MAJOR	NIPPON	PG
AIT	BJC	CSR	GEN	JAS	MAKRO	NMG	PICNI
AJ	BLISS	CTW	GENCO	JCT	MALEE	NNCL	PLE
ALUCON	BNC	CVD	GFPT	JUTHA	MANRIN	NOBLE	POMPUI
AMATA	BTC	CWT	GMMM	KC	MATCH	N-PARK	POST
AMC	BINC	DCC	GOLD	KCE	MATI	NPK	POWER
AP	CCET	DCON	GRAMMY	KDH	M-CHAI	NSM	PPC
APRINT	CCP	DE	GRAND	KH	MCOT	NTV	PR
APURE	CENTEL	DELTA	GYT	KKC	MEDIAS	NWR	PRANDA
AREEYA	CFRESH	DI	HANA	KMC	MFEC	OCC	PRECHA
ASIA	CHOTI	DISTAR	HEMRAJ	KTECH	MIDA	OGC	PSAP
ASIAN	CI	D-MARK	HFT	KTP	MINOR	OHTL	PSL
ASIMAR	CIRKIT	DRACO	HMPRO	KWC	MINT	OISHI	PTT
ATC	CK	DTC	HT	KWH	MK	PA	PTTEP
BAFS	CM	DTCI	HTC	LALIN	MLINK	PAE	PYT
BANPU	CNT	EGCOMP	HTX	LANNA	MODERN	PAF	Q-CON
BAT-3K	CP7-11	EMC	ICC	LEE	MPT	PAP	QH
BATA	CPF	ERAWAN	IEC	LH	MS	PATKL	RAIMON

ตารางที่ ก-1 (ต่อ)

RAM	SC	SPALI	TAF	TNPC	UCOM
RANCH	SCC	SPC	TASCO	TONHUA	UF
RATCH	SCCC	SPG	TBSP	TOP	UFM
RCI	SCG	SPI	TC	TOPP	UMI
RCL	SCP	SPORT	TCB	TPA	UP
RHC	SEAFCO	SPSU	TCCC	TPC	UPF
ROBINS	SE-ED	SRI	TCJ	TPCORP	UPOIC
ROCK	SF	SSC	TCMC	TPIPL	UST
ROH	SFP	SSF	TCOAT	TPP	UT
ROJANA	SH	SSI	TCP	TRAF	UTP
RPC	SHANG	SSSC	TEAM	TRS	UV
RS	SHIN	SST	TF	TRU	UVAN
S.& J	SIM	STA	TFD	TRUBB	VARO
S&P	SINGER	STEC	TFI	TSTE	VIBHA
SAFARI	SINGHA	STHAI	TGCI	TT&T	VNG
SAICO	SIRI	STPI	THIP	TTI	VNT
SAM	SIS	STRD	TICON	TTTM	WACOAL
SAMART	SITHAI	SUC	TIPCO	TUF	WG
SAMCO	SKR	SUN	TKS	TVO	WIN
SAMTEL	SMC	SUSCO	TKT	TWFP	WORK
SATEL	SNC	SVH	TLUXE	TWP	YCI
SAUCE	SORKON	SVI	TMD	TYCN	TRUE
SAWANG	SPACK	SVOA	TNL	UBC	

ภาคผนวก ข

ผลการประมวลผลทางสถิติตามโปรแกรม SPSS

ผลการวิเคราะห์สมการถดถอย

ทดสอบเงื่อนไขที่ 1 ค่าเฉลี่ยของค่าเคลื่อนเท่ากับ 0

ทดสอบเงื่อนไขที่ 2 ค่าแปรปรวนของค่าคลาดเคลื่อนต้องคงที่ (Heteroscedastic)
(ไม่เป็นไปตามเงื่อนไข)

ตารางที่ ข-1 ค่าแปรปรวนของค่าคลาดเคลื่อนต้องคงที่

Test of Homogeneity of Variance

Unstandardized Residual			
Levene Statistic	df1	df2	Sig.
6.976	2	993	0.001

ทดสอบเงื่อนไขที่ 3 ค่าคลาดเคลื่อนต้องเป็นอิสระต่อกัน

ตารางที่ ข-2 ค่าคลาดเคลื่อนต้องเป็นอิสระต่อกัน

Model Summary^a

Model	R	R Square	Adjusted R Square	Std. Error of the Estimate	Durbin-Watson
1	.916 ^a	.838	.837	8.16969	1.920

a. Predictors: (Constant), EPSAUD,CG, DIFF, SIZE, AUD, EPSCG, BV, EPS, EPSDIFF

b. Dependent Variable: PRICE

ทดสอบเงื่อนไขที่ 4 ค่าคลาดเคลื่อนมีการแจกแจงแบบปกติ (ไม่เป็นไปตามเงื่อนไข)

ตารางที่ ข-3 ค่าคลาดเคลื่อนมีการแจกแจงแบบปกติ

Tests of Normality

	Kolmogorov-Smirnov (a)			Shapiro-Wilk		
	Statistic	df	Sig.	Statistic	df	Sig.
Unstandardized Residual	0.92	996	.000	.959	996	.000

a. Lilliefors Significance Correction

ตารางที่ ข-4 ทดสอบค่าแปรอิสระ

ทดสอบเงื่อนไขที่ 5 ตัวแปรอิสระต้องเป็นอิสระกัน

Coefficients^a

Model	Unstandardized		Std. Error	Standardized Coefficients	t	Sig.	95% Confidence Interval for B				Correlations			Collinearity Statistics	
	B	Constant					Lower Bound	Upper Bound	Zero-order	Partial	Part	Tolerance	VIF		
	1	4.245	.477	.084	.131	8.896	.000	3.309	5.182	.621	.211	.087	.439	2.276	
EPS	.567	.084	.131	.688	41.057	.000	.525	.578	.876	.794	.526	.584	1.713		
BV	.552	.181	.181	.013	.824	.410	-.206	.503	-.020	.026	.011	.620	1.613		
DIFF	.149	.581	.581	.002	.139	.890	-1.059	1.220	.114	.004	.002	.834	1.199		
AUD	.080	.861	.861	.043	2.854	.004	.768	4.146	.039	.091	.037	.707	1.414		
CG	2.457	.017	.017	.037	2.645	.008	.012	.078	.079	.084	.034	.843	1.186		
SIZE	.045	.273	.273	.058	3.681	.000	.470	1.542	.230	.116	.047	.663	1.509		
EPSCG	1.006	.015	.015	-.088	-5.065	.000	-.103	-.046	-.031	-.159	-.065	.546	1.832		
EPDIFF	-0.74	.120	.120	.196	9.752	.000	.934	1.405	.681	.297	.125	.408	2.454		

a. Dependent Variable: PRICE

ตารางที่ ข-4 (ต่อ)

Residuals Statistics ^a

	Minimum	Maximum	Mean	Std. Deviation	N
Predicted Value	-15.0721	236.9988	17.4009	18.51387	996
Residual	-22.78564	24.39978	.00000	8.13266	996
Std. Predicted Value	-1.754	11.861	.000	1.000	996
Std. Residual	-2.789	2.987	.000	.995	996

a Dependent Variable: PRICE

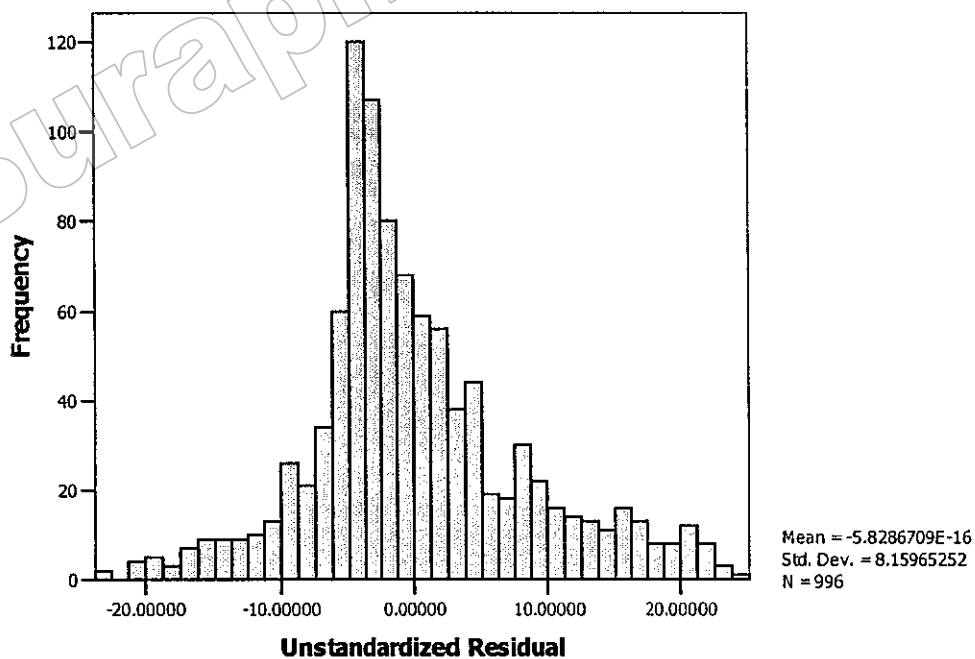
ANOVA ^b

Model		Sum of Squares	df	Mean Square	F	Sig.
1	Regression	341049.63	9	37894.403	567.759	.000 ^a
	Residual	65809.407	986	66.744		
	Total	406859.04	995			

a. Predictors: (Constant), EPSAUD, CG, DIFF, SIZE, AUD, EPSCG, BV, EPS, EPSDIFF

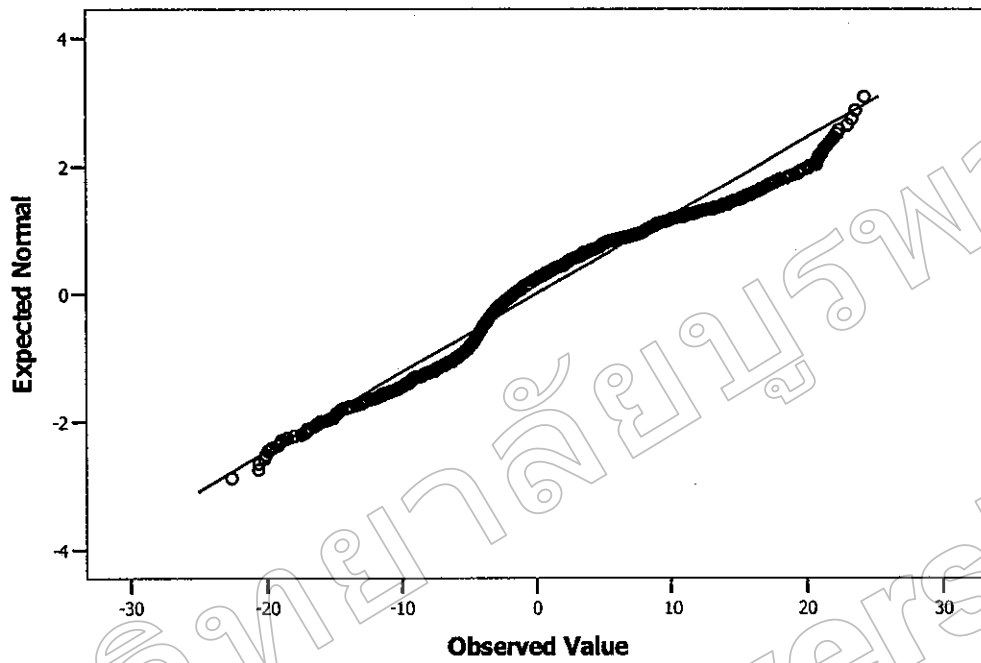
b. Dependent Variable: PRICE

Histogram



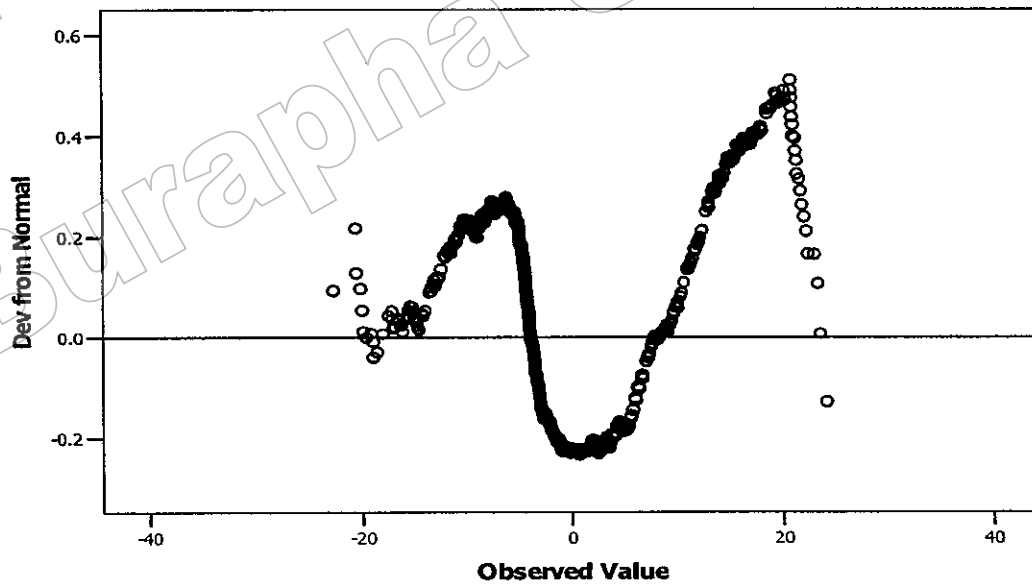
ภาพที่ ข-1 ความถี่ของค่าคลาดเคลื่อน

Normal Q-Q Plot of Unstandardized Residual



ภาพที่ ข-2 ความสัมพันธ์ระหว่างตัวแปรอิสระ

Detrended Normal Q-Q Plot of Unstandardized Residual



ภาพที่ ข-3 ค่าแปรปรวนของค่าตลาดเคลื่อน