



**ภาคผนวก**

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

## ภาคผนวก 1

## กลุ่มอุตสาหกรรมที่มีแนวโน้มดี

แสดงข้อมูลรายเดือนของดัชนีแต่ละกลุ่มอุตสาหกรรม และค่าเฉลี่ยเคลื่อนที่ 12 จวด

ณ สิ้นสุด เดือนธันวาคม 2540

ลำดับ	กลุ่มอุตสาหกรรม	12mav	%diff
1	VEHIC	202.53	- 46.40
2	TRANS	88.50	7.10
3	TEXT	445.59	- 10.90
4	SILO	14.49	- 7.77
5	PULP	233.28	- 20.70
6	PROP	256.71	- 62.77
7	PROF	181.62	- 31.91
8	PRINT	680.32	- 51.04
9	PKG	1009.71	- 37.13
10	PHARM	71.64	- 19.82
11	OTHER	16.88	- 44.90
12	MINE	10.45	- 20.50
13	MACH	18.95	- 40.11
14	JEWEL	25.44	- 17.42
15	INSUR	2885.04	- 19.05
16	HOTEL	98.65	16.13
17	HHOLD	20.88	- 47.71
18	HELTH	127.78	- 41.28
19	FOOD	1610.76	- 14.05
20	FIN	2453.52	- 51.87
21	ETRON	524.90	35.81
22	ENTER	74.39	- 33.22
23	ENERG	5497.27	- 3.25
24	ELEC	333.98	- 32.89
25	COMUN	56.03	- 49.44
26	COMM	2232.27	- 37.03
27	CHEM	234.78	- 42.88
28	BUILD	2046.43	- 55.30
29	BANK	576.95	- 48.46
30	AGRI	39.06	- 3.65

## ภาคผนวก 2

ทุนจดทะเบียนตามราคาตลาดของแต่ละอุตสาหกรรม

ณ เดือน ธันวาคม 2540

(unit :Billion)

ลำดับ	กลุ่มอุตสาหกรรม	มูลค่าตลาด (ล้านบาท)	มูลค่าตลาด (% ทั้งหมด)	grouping	%acc
1	BANK	234,045.62	21.36	28.60	
2	ENERG	181,985.07	16.61	68.12	37.97
3	COMUN	108,289.36	9.88	7.74	
4	TRANS	100,491.51	9.17	86.00	19.05
5	ENTER	53,987.35	4.93	4.23	
6	BUILD	51,849.85	4.73	26.13	
7	ETRON	41,081.36	3.75	9.33	
8	PROP	37,534.83	3.43	11.36	
9	CHEM	33,720.85	3.08	20.31	19.92
10	FOOD	28,067.20	2.56	1.19	
11	FIN	27,762.01	2.53	2.43	
12	PULP	27,042.96	2.47	0.41	
13	INSUR	26,933.07	2.46	6.96	
14	COMM	25,176.90	2.3	2.22	
15	AGRI	24,675.92	2.25	14.21	
16	TEXT	21,587.36	1.97	8.24	
17	HOTEL	19,918.48	1.82	130.38	18.36
18	ELEC	8,670.54	0.79	9.72	
19	PKG	7,903.40	0.72	14.29	
20	VEHIC	6,908.04	0.63	10.53	
21	OTHER	6,276.00	0.57	23.91	
22	PRINT	5,049.91	0.46	12.20	
23	MACH	4,462.23	0.41	5.13	
24	HHOLD	4,265.67	0.39	34.48	
25	HELTH	3,186.92	0.29	61.11	
26	SILO	1,937.40	0.18	38.46	
27	MINE	1,406.92	0.13	85.71	
28	JEWEL	716.25	0.07	133.33	4.64
29	PROF	373.75	0.03	0.00	
30	PHARM	364.25	0.03		0.06
	รวมทั้งหมด	1,095,670.98	100		100

## ภาคผนวก 3

หลักทรัพย์ที่มีทุนจดทะเบียนตามราคาตลาดที่สูงที่สุด 2 อันดับแรก  
ของแต่ละกลุ่มอุตสาหกรรมที่ผ่านการคัดเลือก  
ณ สิ้นสุด เดือนธันวาคม 2540

Sector	Stock	% Mkt. Cap. of Set	Listed date
Bank	BBL	7.85	30 เมษายน 2518
	TFB	4.37	11 กุมภาพันธ์ 2519
Energ	PTTEP	11.58	10 มิถุนายน 2536
	EGCOMP	3.04	16 มกราคม 2538
Comun	ADVANC	4.95	5 พฤศจิกายน 2534
	TA	1.78	22 ธันวาคม 2536
Trans	THAI	6.83	23 กรกฎาคม 2535
	BECL	1.88	31 สิงหาคม 2538
Enter	BEC	3.50	18 กรกฎาคม 2539
	GRAMMY	0.96	17 กุมภาพันธ์ 2538
Build	SCC	2.62	30 เมษายน 2518
	SCCC	0.71	18 เมษายน 2520
Etron	DELTA	2.19	24 กรกฎาคม 2538
	KRP	0.44	8 มิถุนายน 2538
Prop	PRECHA	0.46	18 เมษายน 2539
	MBK	0.34	24 เมษายน 2539
Chem	TPI	0.82	17 มีนาคม 2538
	NPC	0.72	8 กุมภาพันธ์ 2537
Food	SSC	0.62	30 มิถุนายน 2518
	TUF	0.35	22 พฤศจิกายน 2537
Fin	NFS	0.20	30 เมษายน 2518
	TISCO	0.14	2 กรกฎาคม 2539

Pulp	AA	1.48	8 กุมภาพันธ์ 2538
	SPP	0.45	15 ธันวาคม 2530
Insur	BKI	0.49	7 ธันวาคม 2521
	AYUD	0.46	24 สิงหาคม 2530
Comm	MAKRO	1.26	11 สิงหาคม 2537
	BJC	0.32	30 เมษายน 2518
Agri	CPF	0.62	21 ธันวาคม 2530
	PRG	0.15	16 กันยายน 2536
Text	SUC	0.76	25 มิถุนายน 2518
	TUNTEX	0.46	15 กันยายน 2536
Hotel	DTC	0.27	30 เมษายน 2518
	SHANG	0.26	13 กันยายน 2533

ที่มา : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

## ภาคผนวก 4

ตารางแสดงอัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 3 เดือน

ของ บริษัท ธนาคาร กสิกรไทย จำกัด (มหาชน)

ตั้งแต่เดือน มกราคม 2541 ถึง ธันวาคม 2545

(หน่วย : เปอร์เซนต์)

เดือน	2541	2542	2543	2544	2545
มกราคม	10.00	5.50	3.50	3.00	2.25
กุมภาพันธ์	10.00	5.00	3.50	2.50	2.00
มีนาคม	10.00	5.00	3.50	2.50	2.00
เมษายน	10.00	5.00	3.50	2.50	2.00
พฤษภาคม	10.00	5.00	3.50	2.50	2.00
มิถุนายน	10.00	4.75	3.50	2.50	2.00
กรกฎาคม	10.00	4.75	3.25	2.50	2.00
สิงหาคม	10.00	4.50	3.25	2.50	2.00
กันยายน	7.25	4.25	3.00	2.50	2.00
ตุลาคม	6.75	4.25	3.00	2.50	1.75
พฤศจิกายน	6.00	4.00	3.00	2.50	1.75
ธันวาคม	6.00	3.75	3.00	2.25	1.75

ที่มา : บริษัท ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
Copyright © by Chiang Mai University  
All rights reserved

ภาคผนวก 5 ตารางแสดงดัชนีตลาดหลักทรัพย์และค่าเฉลี่ยเคลื่อนที่เปรียบเทียบ

Term	Date	SET	12mav	24mav	36mav	12-24	12-36	24-36
-36	Dec-37	1,360.09						
-35	Jan-38	1,217.74						
-34	Feb-38	1,288.47						
-33	Mar-38	1,216.68						
-32	Apr-38	1,208.69						
-31	May-38	1,392.31						
-30	Jun-38	1,394.77						
-29	Jul-38	1,383.10						
-28	Aug-38	1,314.90						
-27	Sep-38	1,294.23						
-26	Oct-38	1,270.76						
-25	Nov-38	1,196.62						
-24	Dec-38	1,280.81	1,294.86					
-23	Jan-39	1,410.33	1,288.26					
-22	Feb-39	1,321.87	1,304.31					
-21	Mar-39	1,289.73	1,307.09					
-20	Apr-39	1,292.61	1,313.18					
-19	May-39	1,311.91	1,320.17					
-18	Jun-39	1,247.08	1,313.47					
-17	Jul-39	1,064.04	1,301.16					
-16	Aug-39	1,102.32	1,274.57					
-15	Sep-39	1,099.01	1,256.86					
-14	Oct-39	910.33	1,240.59					
-13	Nov-39	925.97	1,210.56					
-12	Dec-39	831.57	1,188.00	1,241.43				
-11	Jan-40	788.04	1,150.56	1,219.41				
-10	Feb-40	727.56	1,098.71	1,201.51				
-9	Mar-40	705.43	1,049.18	1,178.14				
-8	Apr-40	661.29	1,000.49	1,156.83				

Term	Date	SET	12mav	24mav	36mav	12-24	12-36	24-36
-7	May-40	566.39	947.88	1,134.02				
-6	Jun-40	527.28	885.75	1,099.61				
-5	Jul-40	665.62	825.77	1,063.47				
-4	Aug-40	502.23	792.57	1,033.57				
-3	Sep-40	544.54	742.56	999.71				
-2	Oct-40	447.21	696.35	968.47				
-1	Nov-40	395.47	657.76	934.16				
0	Dec-40	372.69	613.55	900.78	1,032.14	- 287.22	- 418.59	- 131.36
1	Jan-41	495.23	575.31	862.94	1,004.71	- 287.63	- 429.40	- 141.77
2	Feb-41	528.42	550.91	824.81	984.64	- 273.90	- 433.73	- 159.83
3	Mar-41	459.11	534.32	791.75	963.53	- 257.43	- 429.21	- 171.78
4	Apr-41	412.13	513.79	757.14	942.49	- 243.35	- 428.70	- 185.35
5	May-41	325.59	493.03	720.45	920.36	- 227.43	- 427.33	- 199.91
6	Jun-41	267.33	472.96	679.36	890.73	- 206.40	- 417.77	- 211.37
7	Jul-41	266.72	451.30	638.53	859.41	- 187.24	- 408.11	- 220.88
8	Aug-41	214.53	418.06	605.31	828.40	- 187.26	- 410.34	- 223.09
9	Sep-41	253.82	394.08	568.32	797.83	- 174.24	- 403.75	- 229.51
10	Oct-41	331.29	369.85	533.10	768.93	- 163.25	- 399.08	- 235.83
11	Nov-41	362.82	360.19	508.98	742.84	- 148.78	- 382.64	- 233.86
12	Dec-41	355.81	357.47	485.51	719.68	- 128.04	- 362.20	- 234.16
13	Jan-42	363.00	356.07	465.69	693.98	- 109.62	- 337.91	- 228.29
14	Feb-42	340.94	345.05	447.98	664.89	- 102.93	- 319.84	- 216.91
15	Mar-42	352.01	329.42	431.87	637.64	- 102.45	- 308.22	- 205.77
16	Apr-42	459.35	320.50	417.14	611.59	- 96.65	- 291.09	- 194.45
17	May-42	453.60	324.43	408.73	588.45	- 84.30	- 264.01	- 179.72
18	Jun-42	521.77	335.10	404.03	564.60	- 68.93	- 229.50	- 160.57
19	Jul-42	456.81	356.31	403.80	544.46	- 47.50	- 188.15	- 140.66
20	Aug-42	440.27	372.15	395.10	527.59	- 22.96	- 155.44	- 132.49
21	Sep-42	389.49	390.96	392.52	509.20	- 1.56	- 118.24	- 116.68
22	Oct-42	395.55	402.26	386.06	489.49	16.20	- 87.23	- 103.43



Term	Date	SET	12mav	24mav	36mav	12-24	12-36	24-36
23	Nov-42	422.12	407.62	383.91	475.19	23.71	67.57	91.28
24	Dec-42	481.92	412.56	385.02	461.20	27.54	48.64	76.18
25	Jan-43	477.57	423.07	389.57	451.48	33.50	28.41	61.91
26	Feb-43	374.32	432.62	388.83	442.86	43.78	10.24	54.03
27	Mar-43	400.32	435.40	382.41	433.05	52.99	2.35	50.64
28	Apr-43	390.40	439.42	379.96	424.57	59.46	14.85	44.61
29	May-43	323.29	433.68	379.06	417.05	54.62	16.63	37.99
30	Jun-43	325.69	422.82	378.96	410.29	43.86	12.53	31.33
31	Jul-43	284.67	406.48	381.39	404.69	25.09	1.79	23.30
32	Aug-43	307.83	392.13	382.14	394.11	9.99	1.98	11.97
33	Sep-43	277.29	381.10	386.03	388.71	4.93	7.61	2.68
34	Oct-43	271.84	371.75	387.01	381.29	15.26	9.54	5.72
35	Nov-43	277.92	361.44	384.53	376.42	23.09	14.98	8.11
36	Dec-43	269.19	349.42	380.99	373.15	31.57	23.73	7.84
37	Jan-44	332.77	331.69	377.38	370.28	45.69	38.58	7.10
38	Feb-44	325.20	319.63	376.12	365.76	56.49	46.14	10.36
39	Mar-44	291.94	315.53	375.47	360.12	59.93	44.58	15.35
40	Apr-44	300.63	306.50	372.96	355.48	66.46	48.97	17.49
41	May-44	310.13	299.02	366.35	352.38	67.33	53.36	13.97
42	Jun-44	322.55	297.93	360.37	351.95	62.45	54.02	8.42
43	Jul-44	297.69	297.66	352.07	353.48	54.41	55.82	1.41
44	Aug-44	335.57	298.75	345.44	354.34	46.69	55.59	8.90
45	Sep-44	277.04	301.06	341.08	357.71	40.02	56.65	16.63
46	Oct-44	275.09	301.04	336.39	358.35	35.35	57.31	21.96
47	Nov-44	302.62	301.31	331.37	356.79	30.06	55.48	25.41
48	Dec-44	303.85	303.37	326.40	355.12	23.03	51.75	28.72
49	Jan-45	340.82	306.26	318.98	353.67	12.72	47.42	34.70
50	Feb-45	371.81	306.93	313.28	353.06	6.35	46.13	39.78
51	Mar-45	373.95	310.81	313.17	353.91	2.36	43.10	40.74
52	Apr-45	371.42	317.65	312.07	354.52	5.57	36.88	42.45

Term	Date	SET	12mav	24mav	36mav	12-24	12-36	24-36
53	May-45	407.96	323.55	311.28	352.08	12.26 -	28.54 -	40.80
54	Jun-45	389.10	331.70	314.81	350.81	16.89 -	19.12 -	36.00
55	Jul-45	376.02	337.24	317.45	347.13	19.79 -	9.89 -	29.68
56	Aug-45	361.16	343.77	321.26	344.88	22.51 -	1.11 -	23.62
57	Sep-45	331.79	345.90	323.48	342.69	22.42	3.22 -	19.21
58	Oct-45	357.22	350.47	325.75	341.08	24.71	9.38 -	15.33
59	Nov-45	364.90	357.31	329.31	340.02	28.00	17.29 -	10.71
60	Dec-45	356.48	362.50	332.93	338.43	29.57	24.07 -	5.50

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
 Copyright © by Chiang Mai University  
 All rights reserved

ภาคผนวก 6 ตารางเปรียบเทียบค่าเฉลี่ยเคลื่อนที่ 12 งวดกับค่าเฉลี่ย 24 งวด  
ของหลักทรัพย์ในกลุ่มอุตสาหกรรมขนาดยักษ์

Term	Date	BBL	KBANK	PTTEP	EGCOMP
1	Jan-41	- 41.50	- 38.19	8.67	- 10.31
2	Feb-41	- 42.10	- 36.10	14.58	- 8.27
3	Mar-41	- 43.10	- 33.98	21.42	- 6.46
4	Apr-41	- 45.04	- 32.75	22.33	- 5.27
5	May-41	- 45.90	- 31.33	27.17	- 4.56
6	Jun-41	- 45.48	- 29.89	30.83	- 2.71
7	Jul-41	- 44.42	- 27.41	31.50	- 1.42
8	Aug-41	- 48.79	- 29.06	23.67	- 1.54
9	Sep-41	- 48.56	- 28.29	22.42	- 0.65
10	Oct-41	- 48.51	- 28.08	19.75	0.13
11	Nov-41	- 48.10	- 27.32	16.83	1.35
12	Dec-41	- 45.17	- 25.45	13.17	2.44
13	Jan-42	- 42.21	- 23.01	5.08	2.67
14	Feb-42	- 40.06	- 22.84	17.58	0.67
15	Mar-42	- 39.11	- 23.34	36.92	- 1.31
16	Apr-42	- 36.34	- 22.39	43.67	- 2.54
17	May-42	- 32.66	- 20.30	49.33	- 2.71
18	Jun-42	- 28.36	- 16.82	52.50	- 2.50
19	Jul-42	- 23.26	- 12.97	53.42	- 2.52
20	Aug-42	- 16.18	- 7.49	52.25	- 2.69
21	Sep-42	- 10.78	- 3.61	48.75	- 3.02
22	Oct-42	- 5.56	0.09	50.00	- 3.82
23	Nov-42	- 1.81	1.78	50.75	- 5.70
24	Dec-42	0.04	2.24	49.33	- 7.10
25	Jan-43	1.83	2.07	43.92	- 8.27
26	Feb-43	3.83	2.60	31.42	- 8.19
27	Mar-43	5.75	3.33	22.79	- 8.29
28	Apr-43	6.48	3.24	22.58	- 8.54

Term	Date	BBL	KBANK	PTTEP	EGCOMP
29	May-43	5.42	1.34	26.58	9.42
30	Jun-43	3.01	1.83	29.50	10.67
31	Jul-43	0.61	5.58	31.58	11.66
32	Aug-43	3.73	9.15	33.79	11.84
33	Sep-43	6.56	11.01	37.21	11.88
34	Oct-43	8.57	12.39	41.79	11.60
35	Nov-43	10.41	12.99	46.67	10.53
36	Dec-43	11.65	13.24	49.92	9.57
37	Jan-44	13.50	13.78	54.42	8.59
38	Feb-44	14.85	13.81	58.88	7.78
39	Mar-44	14.45	13.35	59.63	6.13
40	Apr-44	14.09	12.99	59.38	5.10
41	May-44	12.89	11.82	56.79	4.15
42	Jun-44	10.86	10.08	54.96	2.85
43	Jul-44	8.47	8.46	53.92	1.59
44	Aug-44	6.39	6.81	52.79	0.74
45	Sep-44	4.48	6.05	56.33	0.21
46	Oct-44	3.06	5.55	48.79	0.39
47	Nov-44	1.64	5.09	41.85	0.68
48	Dec-44	0.11	4.41	36.52	1.13
49	Jan-45	1.82	3.47	30.77	1.56
50	Feb-45	3.14	2.93	25.40	2.07
51	Mar-45	3.55	2.59	21.73	1.92
52	Apr-45	4.32	2.00	17.10	2.25
53	May-45	5.01	1.29	13.35	2.73
54	Jun-45	5.71	0.64	9.85	3.02
55	Jul-45	6.15	0.01	7.48	3.01
56	Aug-45	6.80	0.64	4.60	2.86
57	Sep-45	6.80	0.96	1.23	2.76
58	Oct-45	6.89	1.54	1.69	2.72

Term	Date	BBL	KBANK	PTTEP	EGCOMP
59	Nov-45	7.40	2.24	2.98	2.75
60	Dec-45	7.68	2.70	3.73	2.58



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
 Copyright© by Chiang Mai University  
 All rights reserved

## ภาคผนวก 7

ตารางแสดงรายภาษีปิดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์ที่ผ่านการคัดเลือก

Term	Date	BBL	TFB	PTTEP	EGCOMP	ADVANC	TA	THAI	BECL	BEC	GRAMMY
1	Jan-41	87.50	86.00	590.00	86.50	388.00	22.75	63.50	40.25	262	302.00
2	Feb-41	100.00	87.00	514.00	81.50	326.00	23.25	53.00	40.25	252	260.00
3	Mar-41	81.50	75.50	398.00	72.50	306.00	15.00	43.75	36.50	204	202.00
4	Apr-41	77.50	69.00	396.00	62.00	260.00	14.00	40.25	30.50	204	160.00
5	May-41	62.00	46.75	350.00	50.50	224.00	10.50	38.75	23.25	162	108.00
6	Jun-41	43.50	30.50	320.00	54.00	168.00	9.40	35.25	17.00	163	98.00
7	Jul-41	35.00	25.25	342.00	60.00	216.00	10.50	38.00	23.00	165	85.00
8	Aug-41	23.50	17.50	270.00	52.50	164.00	6.60	30.50	19.25	133	82.00
9	Sep-41	23.25	22.00	352.00	59.50	228.00	8.50	32.50	30.00	194	164.00
10	Oct-41	35.75	38.25	340.00	68.00	254.00	14.00	48.00	29.00	226	159.00
11	Nov-41	50.50	50.00	290.00	62.00	208.00	13.25	45.75	34.50	226	182.00
12	Dec-41	52.00	53.50	256.00	63.50	212.00	15.00	47.00	36.00	200	172.00
13	Jan-42	50.50	58.00	266.00	60.00	252.00	17.25	50.00	33.75	181	170.00
14	Feb-42	46.75	51.00	246.00	54.00	246.00	18.25	49.00	29.00	168	170.00
15	Mar-42	51.50	56.00	294.00	55.00	234.00	21.25	53.00	27.00	181	123.00
16	Apr-42	71.50	74.00	342.00	58.00	294.00	32.00	69.00	31.75	196	144.00
17	May-42	76.00	75.00	304.00	54.00	300.00	29.25	63.00	26.50	195	140.00
18	Jun-42	80.50	74.00	280.00	53.50	356.00	35.00	69.50	24.25	228	124.00
19	Jul-42	67.00	66.00	292.00	48.00	346.00	30.75	66.00	24.75	218	105.00
20	Aug-42	58.50	42.00	302.00	43.50	360.00	35.75	67.50	21.00	238	97.00
21	Sep-42	46.75	37.50	284.00	41.75	338.00	27.50	55.00	18.25	226	87.50
22	Oct-42	52.50	36.50	282.00	37.00	330.00	28.25	46.25	18.00	240	84.00
23	Nov-42	53.50	38.00	240.00	34.25	390.00	36.00	55.50	17.75	238	90.00
24	Dec-42	61.00	43.00	232.00	35.00	450.00	48.75	56.50	18.50	266	128.00
25	Jan-43	61.50	42.75	242.00	35.50	386.00	57.00	54.00	17.00	302	149.00
26	Feb-43	39.50	32.50	185.00	24.00	404.00	50.00	34.75	10.50	282	125.00
27	Mar-43	39.00	34.25	195.00	31.50	392.00	53.00	44.00	11.00	276	155.00
28	Apr-43	40.00	33.50	192.00	33.00	382.00	50.00	41.00	12.00	250	125.00

Term	Date	BBL	TFB	PTTEP	EGCOMP	ADVANC	TA	THAI	BECL	BEC	GRAMMY
29	May-43	32.25	27.00	188.00	27.50	360.00	38.75	37.50	9.70	234	100.00
30	Jun-43	30.50	27.50	190.00	29.25	362.00	41.50	36.25	10.00	230	100.00
31	Jul-43	24.25	21.25	189.00	31.50	358.00	26.75	38.75	7.80	236	99.00
32	Aug-43	25.50	21.75	252.00	33.75	350.00	30.75	37.75	7.80	246	101.00
33	Sep-43	22.00	20.00	106.00	30.50	304.00	27.75	34.50	6.30	214	90.00
34	Oct-43	25.25	20.25	107.00	31.75	314.00	25.00	30.75	5.70	206	83.50
35	Nov-43	26.75	20.00	112.00	29.50	352.00	20.75	32.25	5.70	220	85.00
36	Dec-43	25.50	19.50	100.00	30.00	360.00	18.00	32.00	6.00	216	83.00
37	Jan-44	40.00	26.75	111.00	30.50	446.00	26.50	35.00	10.50	246	95.00
38	Feb-44	42.00	25.00	106.00	33.75	420.00	24.00	31.75	11.00	232	96.00
39	Mar-44	35.00	21.25	102.00	32.50	402.00	19.00	28.00	9.60	240	96.50
40	Apr-44	37.50	21.00	104.00	31.00	408.00	19.25	27.75	10.75	228	84.50
41	May-44	37.00	20.75	116.00	32.00	430.00	18.75	29.00	10.75	216	85.00
42	Jun-44	38.00	20.00	125.00	35.25	438.00	18.75	27.75	10.00	242	83.50
43	Jul-44	31.50	16.00	113.00	35.50	416.00	15.00	26.25	9.70	240	82.00
44	Aug-44	38.25	19.75	117.00	36.75	490.00	15.50	28.75	9.90	266	82.50
45	Sep-44	31.25	14.50	109.00	33.50	460.00	9.20	17.75	8.90	226	69.00
46	Oct-44	32.25	15.00	98.50	33.50	41.25	8.80	17.50	8.70	202	80.00
47	Nov-44	36.50	18.40	112.00	35.50	44.50	10.30	19.70	9.60	210	81.50
48	Dec-44	36.50	18.60	106.00	35.50	40.75	10.20	19.50	9.75	206	85.00
49	Jan-45	50.00	23.70	109.00	37.75	40.25	10.00	27.75	14.30	248	106.00
50	Feb-45	54.50	25.75	115.00	39.75	40.75	11.00	30.50	15.60	246	123.00
51	Mar-45	49.50	22.40	120.00	41.50	43.25	9.90	30.25	14.30	266	124.00
52	Apr-45	51.50	25.50	106.00	40.50	41.00	7.95	33.25	14.90	260	130.00
53	May-45	58.50	30.00	128.00	43.50	44.50	7.85	38.00	18.60	246	168.00
54	Jun-45	56.00	28.25	117.00	41.00	39.25	6.70	40.25	16.10	240	179.00
55	Jul-45	54.50	25.75	106.00	36.00	38.75	7.35	39.25	16.60	220	214.00
56	Aug-45	51.00	25.50	122.00	37.25	28.25	6.05	37.00	16.40	228	20.90
57	Sep-45	42.50	22.90	123.00	35.50	32.00	5.25	25.25	14.30	200	18.50
58	Oct-45	51.50	26.50	121.00	36.00	34.25	5.70	32.75	15.80	208	18.40



Term	Date	BBL	TFB	PTTEP	EGCOMP	ADVANC	TA	THAI	BECL	BEC	GRAMMY
59	Nov-45	53.00	27.75	130.00	37.50	36.00	5.35	35.75	15.30	214	19.70
60	Dec-45	49.50	26.00	142.00	37.25	35.50	4.60	32.50	14.90	204	17.90



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved



Term	Date	SCC	SCCC	DELTA	KRP	PRECHA	MBK	TPI	NPC	SSC
1	Jan-41	322	99.00	616.00	169.00	5.60	20.50	7.70	39.00	260.00
2	Feb-41	428	115.00	684.00	149.00	6.60	21.75	11.50	38.50	388.00
3	Mar-41	454	99.50	522.00	99.00	14.25	30.00	11.50	34.75	372.00
4	Apr-41	432	93.00	376.00	101.00	13.25	27.50	5.10	32.50	350.00
5	May-41	258	57.00	304.00	79.00	11.00	26.50	4.30	23.00	270.00
6	Jun-41	180	30.00	240.00	26.50	11.00	15.75	3.00	11.75	200.00
7	Jul-41	218	45.00	159.00	36.00	4.20	14.75	2.70	14.50	162.00
8	Aug-41	188	45.00	155.00	18.00	1.40	16.75	1.70	7.40	150.00
9	Sep-41	230	44.50	228.00	8.70	1.60	17.50	2.80	14.75	150.00
10	Oct-41	370	68.50	195.00	18.25	4.00	25.75	6.10	22.50	165.00
11	Nov-41	500	79.00	186.00	25.00	5.50	22.75	7.60	20.50	210.00
12	Dec-41	560	76.00	190.00	17.75	2.50	21.00	6.00	16.75	190.00
13	Jan-42	578	118.00	179.00	15.00	-	-	6.70	20.00	159.00
14	Feb-42	546	101.00	164.00	13.00	2.70	19.25	5.90	16.50	128.00
15	Mar-42	524	122.00	163.00	10.25	2.60	19.50	5.10	17.00	102.00
16	Apr-42	712	132.00	173.00	12.00	2.40	18.75	9.00	31.75	131.00
17	May-42	660	124.00	208.00	11.50	4.50	19.00	12.75	32.50	152.00
18	Jun-42	692	142.00	308.00	22.25	9.30	30.25	24.00	32.75	171.00
19	Jul-42	592	137.00	230.00	21.50	9.50	29.75	17.50	30.00	170.00
20	Aug-42	592	134.00	300.00	19.50	6.40	26.50	19.00	32.25	175.00
21	Sep-42	488	124.00	362.00	19.75	5.70	22.25	14.75	32.00	154.00
22	Oct-42	572	135.00	316.00	20.00	5.00	23.00	19.00	34.75	136.00
23	Nov-42	636	159.00	430.00	17.00	4.50	24.25	17.75	39.25	131.00
24	Dec-42	740	179.00	438.00	27.75	4.00	24.50	17.50	41.00	136.00
25	Jan-43	628	156.00	402.00	25.50	2.80	23.00	16.50	45.00	129.00
26	Feb-43	448	112.00	430.00	21.75	1.80	19.50	10.00	39.25	107.00
27	Mar-43	526	121.00	478.00	22.50	2.40	18.25	8.60	40.00	109.00
28	Apr-43	526	111.00	394.00	23.00	3.00	18.75	9.30	43.50	115.00

Term	Date	SCC	SCCC	DELTA	KRP	PRECHA	MBK	TPI	NPC	SSC
29	May-43	442	104.00	266.00	18.50	3.00	18.00	5.30	29.00	104.00
30	Jun-43	434	139.00	260.00	17.00	2.70	18.00	4.90	29.50	98.00
31	Jul-43	314	112.00	292.00	14.50	2.40	18.00	4.00	25.00	83.00
32	Aug-43	332	122.00	302.00	12.25	3.30	18.00	4.20	26.50	83.00
33	Sep-43	264	100.00	232.00	8.80	2.80	17.25	4.00	28.75	75.00
34	Oct-43	280	106.00	210.00	4.70	2.10	15.25	3.80	29.50	74.00
35	Nov-43	288	110.00	258.00	4.20	2.50	15.00	3.70	28.50	85.50
36	Dec-43	278	118.00	195.00	4.00	2.90	17.75	3.60	29.00	90.50
37	Jan-44	318	132.00	216.00	6.30	2.60	18.75	4.50	28.75	93.00
38	Feb-44	296	120.00	206.00	6.00	1.90	19.75	4.10	35.25	92.50
39	Mar-44	260	128.00	198.00	4.70	1.90	18.75	2.20	26.00	90.00
40	Apr-44	300	138.00	206.00	5.30	1.20	18.50	1.90	27.25	83.00
41	May-44	390	123.00	208.00	5.10	0.70	20.75	3.30	31.00	118.00
42	Jun-44	426	127.00	218.00	5.50	-	24.25	3.30	35.25	152.00
43	Jul-44	374	129.00	206.00	4.80	-	22.50	3.10	35.75	140.00
44	Aug-44	468	150.00	230.00	4.70	-	24.50	3.90	35.00	156.00
45	Sep-44	408	146.00	169.00	2.70	-	22.75	2.30	30.00	146.00
46	Oct-44	404	136.00	185.00	2.70	-	23.00	2.30	30.75	152.00
47	Nov-44	448	128.00	24.60	2.82	-	24.00	2.30	33.75	147.00
48	Dec-44	464	143.00	28.00	2.94	-	24.10	2.64	32.25	154.00
49	Jan-45	644	144.00	39.25	5.30	-	26.25	2.94	45.50	170.00
50	Feb-45	752	161.00	37.50	3.98	-	29.25	3.28	43.00	242.00
51	Mar-45	836	200.00	39.50	3.60	-	28.75	3.10	51.50	242.00
52	Apr-45	854	202.00	35.50	3.68	-	28.00	3.28	46.50	234.00
53	May-45	950	238.00	35.00	3.42	-	28.75	3.40	52.50	258.00
54	Jun-45	950	224.00	27.00	2.90	-	29.50	4.42	52.00	250.00
55	Jul-45	962	198.00	29.75	2.74	-	30.25	4.26	49.00	214.00
56	Aug-45	908	194.00	27.25	2.32	-	30.25	3.84	49.50	220.00
57	Sep-45	752	188.00	25.50	2.16	-	30.50	2.70	46.00	204.00
58	Oct-45	974	195.00	30.00	2.42	-	30.50	3.52	49.00	208.00

Term	Date	SCC	SCCC	DELTA	KRP	PRECHA	MBK	TPI	NPC	SSC
59	Nov-45	1,124	192.00	29.50	2.44	-	35.25	2.98	46.50	204.00
60	Dec-45	1,172	210.00	27.25	2.08	-	34.00	2.90	47.00	214.00



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
 Copyright © by Chiang Mai University  
 All rights reserved

Term	Date	TUF	NFS	TISCO	AA	SPP	BKI	AYUD	MAKRO	BJC	CPF
1	Jan-41	128.00	14.75	26.00	38.50	30.75	246	160.00	99.50	52.00	65.50
2	Feb-41	155.00	21.75	43.00	41.75	30.00	298	204.00	79.00	51.00	70.00
3	Mar-41	134.00	18.25	33.75	37.00	31.75	290	175.00	69.50	48.00	57.00
4	Apr-41	150.00	14.25	20.00	39.00	33.50	270	160.00	63.50	44.00	39.25
5	May-41	143.00	9.10	10.50	34.50	33.00	220	160.00	60.00	39.00	41.00
6	Jun-41	130.00	3.00	5.00	36.50	29.00	195	154.00	58.00	40.00	31.00
7	Jul-41	133.00	3.30	6.20	37.00	27.00	191	154.00	55.00	39.00	31.00
8	Aug-41	137.00	3.50	5.80	31.00	23.50	103	154.00	53.00	35.50	27.00
9	Sep-41	135.00	4.00	7.70	30.00	23.50	102	140.00	62.00	39.00	27.00
10	Oct-41	140.00	8.90	10.50	28.75	27.00	121	120.00	67.00	40.00	38.00
11	Nov-41	130.00	11.25	19.00	27.50	33.75	160	138.00	75.00	78.00	46.75
12	Dec-41	145.00	10.75	14.25	20.00	47.00	135	130.00	71.00	65.00	44.25
13	Jan-42	125.00	11.00	15.50	20.00	44.50	124	126.00	73.00	60.00	42.50
14	Feb-42	125.00	9.30	12.25	19.25	50.50	125	119.00	69.50	67.00	45.25
15	Mar-42	111.00	9.90	12.75	16.00	66.00	112	127.00	65.00	60.00	38.25
16	Apr-42	110.00	16.00	23.50	28.00	82.00	118	92.00	68.00	68.00	49.00
17	May-42	146.00	19.00	24.50	26.75	81.00	132	98.50	77.50	59.00	45.00
18	Jun-42	128.00	20.75	50.00	27.50	80.00	139	119.00	67.00	53.00	57.50
19	Jul-42	126.00	17.75	36.50	22.00	80.00	136	119.00	71.50	50.50	72.00
20	Aug-42	121.00	15.50	36.75	22.00	82.00	137	119.00	72.00	50.50	117.00
21	Sep-42	136.00	11.25	27.75	16.00	78.00	126	113.00	72.00	49.00	100.00
22	Oct-42	125.00	12.75	24.50	18.25	80.00	128	103.00	64.50	44.75	92.00
23	Nov-42	126.00	13.00	25.00	19.00	85.00	127	105.00	65.00	45.50	106.00
24	Dec-42	132.00	15.75	30.50	19.00	76.00	124	99.00	53.00	49.00	103.00
25	Jan-43	121.00	13.50	26.00	18.25	74.50	127	97.50	53.00	45.00	127.00
26	Feb-43	110.00	8.50	15.50	14.00	70.50	114	88.00	41.00	37.00	138.00
27	Mar-43	117.00	9.00	17.25	15.00	78.00	100	85.50	44.75	32.25	143.00
28	Apr-43	102.00	8.90	17.00	18.75	95.00	108	89.00	46.50	33.50	78.00

Term	Date	TUF	NFS	TISCO	AA	SPP	BKI	AYUD	MAKRO	BJC	CPF
29	May-43	83.50	5.90	12.25	16.00	95.00	103	96.00	43.50	33.00	58.00
30	Jun-43	83.50	5.50	12.25	17.25	93.00	103	93.00	46.50	32.00	58.50
31	Jul-43	91.50	4.20	10.75	17.00	95.00	105	92.00	45.00	33.75	39.50
32	Aug-43	88.50	5.50	12.00	16.75	92.00	114	99.50	53.50	36.50	50.50
33	Sep-43	90.00	5.00	12.25	16.50	93.00	111	92.50	50.00	29.75	47.75
34	Oct-43	48.00	4.80	15.25	14.75	-	112	91.50	51.50	27.75	44.50
35	Nov-43	48.00	5.60	16.50	15.00	92.00	116	92.50	52.00	27.50	40.75
36	Dec-43	50.00	5.30	15.50	14.75	93.00	117	92.00	52.00	26.25	38.75
37	Jan-44	49.50	9.80	20.50	13.25	105.00	122	95.00	56.00	26.00	42.50
38	Feb-44	59.00	9.50	18.50	14.00	132.00	132	102.00	61.50	25.25	42.25
39	Mar-44	65.00	7.00	14.00	13.00	124.00	140	92.50	62.50	22.00	39.75
40	Apr-44	65.50	8.20	15.25	13.75	130.00	140	95.00	57.00	24.50	41.75
41	May-44	69.00	8.70	15.25	14.25	132.00	155	95.00	51.50	30.50	40.50
42	Jun-44	68.50	9.40	15.25	14.25	130.00	171	96.50	50.00	30.75	49.75
43	Jul-44	66.50	8.10	14.00	14.25	135.00	171	98.50	47.25	27.25	46.75
44	Aug-44	66.00	9.40	15.25	15.00	150.00	171	98.00	44.75	26.25	53.50
45	Sep-44	63.50	7.30	10.25	13.75	150.00	157	89.00	39.75	22.75	5.30
46	Oct-44	70.00	7.70	10.25	13.75	151.00	161	90.00	39.75	23.50	5.20
47	Nov-44	14.70	9.50	14.30	14.20	153.00	158	89.50	41.00	39.75	5.10
48	Dec-44	16.80	9.45	16.20	15.00	158.00	166	95.00	39.50	41.00	5.45
49	Jan-45	20.50	12.80	16.60	15.10	180.00	200	104.00	44.75	40.00	6.00
50	Feb-45	21.80	13.80	19.90	15.10	214.00	242	110.00	40.25	40.00	7.30
51	Mar-45	24.20	12.40	17.80	18.20	198.00	180	102.00	37.50	40.50	6.60
52	Apr-45	21.60	13.00	18.40	17.20	204.00	180	115.00	41.25	42.00	5.70
53	May-45	18.40	16.70	26.50	17.80	200.00	190	128.00	47.50	47.00	5.60
54	Jun-45	17.50	14.50	24.80	17.00	210.00	192	134.00	44.00	47.00	5.30
55	Jul-45	15.80	14.10	25.50	15.40	220.00	190	135.00	44.00	47.00	5.15
56	Aug-45	16.60	13.80	24.20	16.00	199.00	195	137.00	48.75	48.00	4.56
57	Sep-45	17.50	12.30	20.50	15.80	192.00	195	136.00	47.00	45.00	4.12
58	Oct-45	18.10	14.60	23.00	16.10	196.00	197	137.00	48.00	44.50	4.42

Term	Date	TUF	NFS	TISCO	AA	SPP	BKI	AYUD	MAKRO	BJC	CPF
59	Nov-45	18.30	15.00	23.60	14.30	198.00	204	141.00	35.75	45.00	4.32
60	Dec-45	17.00	13.30	22.40	14.40	195.00	206	142.00	32.00	45.00	4.20



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
 Copyright© by Chiang Mai University  
 All rights reserved



Term	Date	PRG	SUC	TUNTEX	DTC	SHANG
1	Jan-41	28.75	31.75	19.00	36.00	25.50
2	Feb-41	27.25	32.50	18.50	49.00	27.00
3	Mar-41	30.00	26.00	20.75	48.50	25.00
4	Apr-41	25.25	20.75	18.00	49.50	18.25
5	May-41	25.00	19.75	17.00	46.00	17.00
6	Jun-41	26.00	24.25	18.25	42.50	18.25
7	Jul-41	25.00	15.75	20.50	32.00	18.25
8	Aug-41	22.00	10.50	18.75	32.00	18.00
9	Sep-41	22.00	12.00	19.00	29.00	25.00
10	Oct-41	20.50	11.50	16.00	32.00	25.00
11	Nov-41	18.25	14.75	12.50	40.00	27.00
12	Dec-41	19.75	14.75	12.75	40.00	28.00
13	Jan-42	-	15.75	12.75	-	26.00
14	Feb-42	17.00	14.75	10.50	28.25	22.75
15	Mar-42	17.25	14.00	8.40	30.00	23.25
16	Apr-42	18.25	15.75	8.40	40.00	22.25
17	May-42	18.00	13.75	11.25	39.00	23.00
18	Jun-42	20.00	16.25	21.00	42.00	37.00
19	Jul-42	20.00	13.75	20.00	45.00	31.25
20	Aug-42	20.75	12.50	14.50	43.00	34.25
21	Sep-42	20.75	12.50	10.75	40.00	35.00
22	Oct-42	22.50	12.75	11.75	40.00	31.00
23	Nov-42	22.50	12.75	11.75	38.00	32.00
24	Dec-42	22.75	12.25	10.75	33.00	30.00
25	Jan-43	21.00	13.25	13.75	40.00	30.00
26	Feb-43	21.50	11.75	10.00	36.75	29.75
27	Mar-43	19.25	11.25	10.75	23.00	28.25
28	Apr-43	19.50	11.50	10.50	25.00	27.50

Term	Date	PRG	SUC	TUNTEX	DTC	SHANG
29	May-43	-	10.75	8.00	24.75	33.00
30	Jun-43	-	10.75	8.70	24.00	31.00
31	Jul-43	14.00	10.25	7.60	18.25	27.00
32	Aug-43	15.00	10.25	6.80	23.50	28.00
33	Sep-43	19.00	10.50	5.60	24.50	27.00
34	Oct-43	18.00	11.00	5.70	20.00	33.00
35	Nov-43	17.00	10.75	5.70	20.00	26.50
36	Dec-43	19.50	11.75	5.90	22.00	26.00
37	Jan-44	19.75	11.75	6.10	25.00	25.50
38	Feb-44	19.25	13.25	6.20	27.25	39.00
39	Mar-44	-	10.25	5.20	28.00	34.75
40	Apr-44	19.25	10.75	4.40	29.00	29.00
41	May-44	20.50	13.50	4.30	28.25	33.00
42	Jun-44	23.00	13.75	4.40	30.50	36.00
43	Jul-44	22.00	13.25	6.90	27.50	34.50
44	Aug-44	25.00	13.25	7.00	29.50	36.00
45	Sep-44	23.00	11.75	6.00	28.00	32.00
46	Oct-44	27.00	12.50	5.50	27.25	36.00
47	Nov-44	25.00	12.90	5.60	26.25	30.00
48	Dec-44	25.75	13.50	5.40	29.00	33.00
49	Jan-45	27.00	15.20	5.40	31.00	32.00
50	Feb-45	26.00	15.50	5.30	33.00	34.00
51	Mar-45	23.00	14.20	4.94	38.50	33.00
52	Apr-45	30.00	14.20	4.98	33.00	33.00
53	May-45	25.25	16.10	4.88	37.00	31.00
54	Jun-45	25.00	16.00	4.96	38.00	31.00
55	Jul-45	30.00	15.30	4.96	37.00	30.00
56	Aug-45	24.00	15.90	4.46	37.25	30.00
57	Sep-45	24.00	15.10	4.00	38.00	29.00
58	Oct-45	25.00	16.70	3.96	37.50	29.00



Term	Date	PRG	SUC	TUNTEX	DTC	SHANG
59	Nov-45	25.00	17.40	3.56	39.00	29.00
60	Dec-45	26.00	17.70	3.06	42.00	30.00



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
 Copyright© by Chiang Mai University  
 All rights reserved

ภาคผนวก 8 ตารางสรุปค่าตัวแปรที่ใช้ในการคำนวณ ณ สิ้นสุดงวดการลงทุนที่ 0 เพื่อพิจารณาการลงทุนในงวดที่ 1 (มกราคม 2541)

Rf = 0.10

No.	Stock	Ri	Var.i	SD.i	Cov.i	Bi	Var.Ei	Gi	Ci	Wi	เด็ก(%)
1	SET	1.23	18,126.78	134.64	18,126.78	1.00	-	-	-	-	
2	BKJ	0.91	2,601.33	51.00	952.65	0.37	2,252.46	2.21484	0.0008493	-6.96	
3	SCC	1.34	34,611.15	186.04	22,212.04	0.64	33,539.78	1.93478	0.0007349	-0.72	
4	ADVANC	1.67	809.15	28.45	666.61	0.82	-	1.90863	0.0007339	31.76	32
5	AYUD	0.80	570.52	23.89	639.98	1.12	-	0.62402	0.0002400	5.00	5
6	SSC	1.00	5,290.52	72.74	7,738.87	1.46	-	0.61527	0.0002365	63.08	63
7	GRAMMY	1.44	2,784.97	52.77	6,252.09	2.24	-	0.59605	0.0002292	2.50	
8	SCCC	1.90	1,239.93	35.21	3,954.56	3.19	-	0.56559	0.0002175	1.38	
9	TISCO	1.73	661.86	25.73	2,780.86	4.20	-	0.38874	0.0001495	0.70	
10	MAKRO	1.73	604.21	24.58	2,573.45	4.26	-	0.38280	0.0001472	0.68	
11	TA	2.59	184.55	13.58	1,649.24	8.94	-	0.27809	0.0001069	0.23	
12	BBL	1.02	1,207.17	34.74	4,154.99	3.44	-	0.26655	0.0001025	0.60	
13	BEC	1.36	485.90	22.04	2,431.22	5.00	-	0.25274	0.0000972	0.38	
14	KBANK	1.43	399.14	19.98	2340.136354	5.86	-	0.22742	0.0000875	0.29	
15	CPF	1.15	90.55	9.52	556.29	6.14	-	0.17077	0.0000657	0.21	
16	NPC	1.53	10.10	3.18	97.30	9.64	-	0.14832	0.0000570	0.11	
17	NFS	1.72	120.10	10.96	1,313.71	10.94	-	0.14766	0.0000568	0.10	

No.	Stock	Ri	Var.i	SD.i	Cov.i	Bi	Var.Ei	Gi	Ci	Wi	น้ำหนัก(%)
17	BJC	0.85	309.91	17.60	1,757.04	5.67	- 83,303.34	0.13272	0.0000510	0.17	
18	BECL	1.50	12.06	3.47	138.64	11.49	- 343,635.01	0.12221	0.0000470	0.08	
19	TPI	1.67	69.45	8.33	965.87	13.91	- 503,072.95	0.11317	0.0000435	0.06	
20	EGCOMP	1.35	27.16	5.21	318.7611458	11.74	- 358,363.67	0.10663	0.0000410	0.07	
21	AA	0.96	148.02	12.17	1,307.86	8.84	- 202,945.22	0.09694	0.0000373	0.08	
22	MBK	0.90	10.48	3.24	97.71	9.32	- 226,090.51	0.08593	0.0000330	0.07	
23	TUNTEX	0.77	8.49	2.91	67.62	7.97	- 165,149.82	0.08379	0.0000322	0.08	
24	SPP	0.98	49.70	7.05	666.55	13.41	- 467,870.30	0.06591	0.0000253	0.04	
25	PRECHA	0.07	12.24	3.50	28.80	2.35	- 14,381.82	- 0.01417	- 0.0000054	100.00	100
26	PRG	1.06	4.04	2.01	161.84	- 40.02	- 4,167,093.65	- 0.02386	- 0.0000092		
27	SHANG	1.17	5.56	2.36	81.66	- 14.69	- 561,004.31	- 0.07303	- 0.0000281		
28	SUC	1.14	25.51	5.05	276.72	- 10.85	- 306,193.13	- 0.09624	- 0.0000370		
29	THAI	1.19	44.81	6.69	272.86	- 6.09	- 96,419.46	- 0.17849	- 0.0000686		
30	DTC	1.01	101.13	10.06	482.92	- 4.78	- 59,221.15	- 0.19141	- 0.0000736		
31	TUF	1.66	333.21	18.25	1,667.53	- 5.00	- 64,817.13	- 0.31219	- 0.0001201		
32	KRP	0.93	2,709.30	52.05	2,626.38	- 0.97	264.74	- 0.85473	- 0.0003286		
33	PTTEP	1.44	1,405.09	37.48	-1445.78167	- 1.03	.1,349.09	- 1.30134	- 0.0005004		
34	DELTA	1.54	16,067.07	126.76	13,609.10	- 0.85	14,200.77	- 1.70008	- 0.0006516		

ภาคผนวก 9 ตารางสรุป ค่าตัวแปรที่ใช้ในการคำนวณ ณ สิ้นสุดงวดการลงทุนที่ 21 เพื่อพิจารณาการลงทุนในงวดที่ 22 (ตุลาคม 2542)

Rf = 0.0425

No.	Stock	Ri	Var.i	SD.i	Cov.i	Bi	Var.Ei	Gi	Ci	Wi(%)
1	SET	1.02	8071.91	89.84	8,071.91	1.00	8,054.18	-	-	-
2	TUNTEX	1.09	17.73	4.21	3.58	0.20	17.01	5.20273	0.126104	
3	SCC	1.17	28,136.76	167.74	9,642.75	0.34	28,134.68	3.29617	0.000244	
4	DELTA	0.87	23,370.15	152.87	8,125.35	0.35	23,368.01	2.38848	0.000219	
5	PTTEP	0.99	7,099.73	84.26	3,073.70	0.43	7,096.41	2.19540	0.001020	
6	SSC	0.88	6,590.46	81.18	2,807.24	0.43	6,587.24	1.97349	0.000955	
7	BKI	1.02	3,968.71	63.00	2,083.08	0.52	3,963.83	1.85448	0.002236	
8	AA	1.14	63.56	7.97	51.42	0.81	51.96	1.35739	0.061123	
9	GRAMMY	0.96	3,208.99	56.65	2,347.27	0.73	3,199.50	1.25433	0.003533	
10	KRP	1.01	2,264.72	47.59	1,877.23	0.83	2,252.54	1.17041	0.005776	
11	PRECHA	8.77	15.35	3.92	118.63	7.73	1,043.61	1.12954	0.067457	
12	ADVANC	0.98	4,195.96	64.78	4,812.58	1.15	4,172.64	0.81418	0.004141	
13	SCCC	1.09	1,240.67	35.22	2,461.09	1.98	1,170.90	0.52741	0.015281	
14	SPP	1.03	532.92	23.09	1,012.21	1.90	468.96	0.51762	0.020654	
15	BEC	1.06	1,074.35	32.78	2,136.85	1.99	1,004.21	0.51255	0.015994	
16	PRG	1.08	15.35	3.92	36.84	2.40	86.77	0.43410	0.025716	
16	CPF	0.92	528.49	22.99	1,170.43	2.21	441.53	0.39622	0.017373	

No.	Stock	Ri	Var.i	SD.i	Cov.i	Bi	Var.Ei	Gi	Ci	Wi(%)
17	EGCOMP	0.89	123.09	11.09	291.19	2.37	23.87	0.35666	0.019847	100
18	BJC	0.91	133.24	11.54	369.80	2.78	3.34	0.31374	0.017720	
19	BBL	1.12	437.60	20.92	1,644.32	3.76	187.26	0.28755	0.015562	
20	KBANK	0.97	434.12	20.84	1,618.72	3.73	187.61	0.24964	0.013500	
21	BECL	0.99	47.61	6.90	268.81	5.65	517.59	0.16716	0.009942	
22	SUC	1.02	39.99	6.32	249.48	6.24	650.05	0.15669	0.009333	
23	THAI	0.84	151.77	12.32	856.76	5.65	413.24	0.14143	0.008320	
24	TISCO	0.88	169.69	13.03	1,009.89	5.95	458.29	0.14121	0.008306	
25	MAKRO	0.90	97.00	9.85	587.86	6.06	554.20	0.14080	0.008342	
26	TA	1.03	83.60	9.14	615.04	7.36	876.03	0.13386	0.007960	
27	DTC	1.00	46.24	6.80	341.82	7.39	922.64	0.12953	0.007720	
28	NPC	1.09	88.88	9.43	750.18	8.44	1,174.20	0.12362	0.007358	
29	TPI	1.29	35.59	5.97	388.75	10.92	2,079.82	0.11404	0.006810	
30	SHANG	0.89	32.80	5.73	272.90	8.32	1,194.55	0.10135	0.006048	
31	MBK	1.03	23.79	4.88	242.88	10.21	1,824.22	0.09709	0.005799	
32	NFS	1.13	32.99	5.74	475.89	14.43	3,656.42	0.07562	0.004518	
33	AYUD	0.91	716.71	26.77	69.56	0.10	716.54	8.95377	-0.002078	
34	TUF	0.92	133.29	11.55	5.44	0.04	133.26	-21.47874	-0.004742	

ภาคผนวก 10 ตารางสรุปค่าตัวแปรที่ใช้ในการคำนวณ ณ สิ้นสุดงวดการลงทุนที่ 26 เพื่อพิจารณาการลงทุนในงวดที่ 27 (มีนาคม 2543)

No.	Stock	Ri	Var.i	SD.i	Cov.i	Bi	Var.Ei	Gi	Ci	Wi
	SET	1.07	7,186.06	84.77	7,186.06	1.00	-	-	-	-
1	PTTEP	1.05	7,437.40	86.24	1,814.40	0.24	7,009.72	4.17720	0.000580	
2	EGCOMP	1.31	211.26	14.53	68.28	0.32	-	3.95262	0.000550	
3	SSC	1.02	6,147.62	78.41	1,788.90	0.29	5,539.14	3.38049	0.000470	
4	SCC	1.17	28,024.25	167.40	9,574.05	0.34	27,185.54	3.33429	0.000462	
5	DELTA	1.11	21,441.99	146.43	7,557.22	0.35	20,549.33	3.05470	0.000424	
6	BKI	0.88	3,461.42	58.83	1,398.91	0.40	2,287.71	2.08390	0.000290	
7	GRAMMY	1.24	2,875.04	53.62	1,762.81	0.61	173.48	1.96528	0.000273	100
8	KRP	1.03	1,879.82	43.36	1,392.36	0.74	-	1.34940	0.000188	
9	ADVANC	0.97	6,038.06	77.70	4,935.40	0.82	1,236.96	1.14426	0.000159	
10	CPF	1.04	1,091.57	33.04	1,376.49	1.26	-	0.79399	0.000111	
11	BEC	0.98	1,653.06	40.66	2,271.33	1.37	-	0.68684	0.000096	
12	SCCC	1.08	1,561.97	39.52	2,546.67	1.63	-	0.64116	0.000089	
13	SPP	1.11	566.39	23.80	1,029.49	1.82	-	0.58944	0.000082	
14	BECL	1.05	63.18	7.95	144.85	2.29	-	0.44168	0.000061	
15	BJC	0.87	118.86	10.90	269.06	2.26	-	0.36959	0.000051	
16	PRG	0.90	12.25	3.50	29.11	2.38	-	0.36205	0.000050	
17	MAKRO	1.09	123.52	11.11	381.92	3.09	-	0.34168	0.000048	

No.	Stock	Ri	Var.i	SD.i	Cov.i	Bi	Var.Ei	Gi	Ci	Wi
18	KBANK	1.05	389.18	19.73	1,226.88	3.15	- 71,026.57	0.32319	0.000045	
19	TA	1.06	185.33	13.61	719.10	3.88	- 108,002.39	0.26417	0.000037	
20	BBL	0.99	366.10	19.13	1,355.88	3.70	- 98,201.43	0.25714	0.000036	
21	PRECHA	1.33	13.55	3.68	77.04	5.69	- 232,284.09	0.22835	0.000032	
22	THAI	1.27	134.91	11.62	741.05	5.49	- 216,684.21	0.22414	0.000031	
23	SUC	0.96	35.68	5.97	168.95	4.74	- 161,087.32	0.19481	0.000027	
24	TISCO	1.11	142.27	11.93	873.54	6.14	- 270,770.68	0.17555	0.000024	
25	NPC	1.02	109.91	10.48	735.69	6.69	- 321,853.21	0.14702	0.000020	
26	SHANG	0.95	31.19	5.58	258.78	8.30	- 494,645.57	0.11023	0.000015	
27	DTC	0.63	38.45	6.20	254.90	6.63	- 315,780.24	0.08913	0.000012	
28	TPI	0.86	39.23	6.26	379.88	9.68	- 673,785.71	0.08520	0.000012	
29	MBK	0.94	19.55	4.42	208.96	10.69	- 820,943.55	0.08429	0.000012	
30	NFS	1.06	27.57	5.25	405.44	14.71	-1,554,042.13	0.06962	0.000010	
31	TUNTEX	1.08	17.14	4.14	- 21.20	- 1.24	- 10,976.49	-0.84083	-0.000117	100
32	AYUD	0.97	822.44	28.68	- 324.85	- 0.39	- 298.67	-2.37122	-0.000330	
33	AA	1.07	70.48	8.40	- 27.02	- 0.38	- 985.68	-2.70346	-0.000376	
34	TUF	1.06	133.34	11.55	- 38.45	- 0.29	- 464.19	-3.56719	-0.000496	



ภาคผนวก 11 ตารางสรุปค่าตัวแปรที่ใช้ในการคำนวณ ณ สิ้นสุดงวดการลงทุนที่ 31 เพื่อพิจารณาการลงทุนในงวดที่ 32 (สิงหาคม 2543)

No.	Stock	Ri	Var.i	SD.i	Cov.i	Bi	Var.Ei	Gi	Ci	Wi
	SET	1.08	6,623.85	81.39	6,623.85	1.00	-	-	-	-
1	PTTEP	1.33	8,380.58	91.55	2,339.60	0.28	7,864.35	4.65966	0.000702	
2	DELTA	1.03	19,214.78	138.62	6,653.60	0.35	18,420.54	2.89292	0.000435	
3	SCC	1.06	24,529.02	156.62	8,776.80	0.36	23,680.97	2.86414	0.000431	
4	SSC	1.00	6,144.89	78.39	2,113.87	0.34	5,361.03	2.81246	0.000424	
5	BKI	1.09	3,291.67	57.37	1,517.61	0.46	1,883.68	2.28440	0.000345	
6	AA	0.99	72.00	8.49	38.82	0.54	1,853.56	1.76716	0.000267	21
7	ADVANC	0.98	5,890.60	76.75	3,737.17	0.63	3,224.50	1.48977	0.000225	
8	GRAMMY	1.02	2,577.20	50.77	1,788.41	0.69	612.49	1.42333	0.000215	67
9	EGCOMP	1.07	254.05	15.94	214.86	0.85	4,483.82	1.22843	0.000185	
10	CPF	1.28	1,144.66	33.83	1,294.85	1.13	7,331.45	1.10146	0.000166	
11	TUF	0.97	312.70	17.68	266.38	0.85	4,494.12	1.09725	0.000166	
12	SPP	0.97	674.50	25.97	594.23	0.88	4,466.60	1.06235	0.000160	
13	KRP	0.84	1,621.50	40.27	1,315.61	0.81	2,738.95	1.00120	0.000151	12
14	BEC	1.04	1,565.45	39.57	1,798.29	1.15	7,175.36	0.87912	0.000133	
15	SCCC	1.09	1,347.91	36.71	2,058.88	1.53	14,106.44	0.69186	0.000104	
16	TUNTEX	0.89	19.20	4.38	28.14	1.47	14,209.20	0.58831	0.000089	
17	BJC	1.08	141.63	11.90	336.24	2.37	37,191.87	0.44185	0.000067	



No.	Stock	Ri	Var.i	SD.i	Cov.i	Bi	Var.Ei	Gi	Ci	Wi
18	TA	1.15	212.91	14.59	552.50	2.59	- 44,392.03	0.43046	0.000065	
19	MAKRO	1.19	165.25	12.85	457.60	2.77	- 50,627.25	0.41760	0.000063	
20	BECL	1.00	88.58	9.41	233.21	2.63	- 45,824.19	0.36748	0.000055	
21	KBANK	1.02	397.98	19.95	1,206.00	3.03	- 60,427.09	0.32704	0.000049	
22	BBL	1.05	391.67	19.79	1,331.90	3.40	- 76,205.57	0.29967	0.000045	
23	DTC	1.29	69.02	8.31	330.28	4.79	- 151,609.87	0.26230	0.000040	
24	PRG	1.07	13.61	3.69	55.21	4.06	- 108,987.20	0.25611	0.000039	
25	PRECHA	1.38	12.50	3.54	84.66	6.77	- 303,828.93	0.19822	0.000030	
26	SUC	1.00	33.97	5.83	179.90	5.30	- 185,738.66	0.18269	0.000028	
27	TISCO	1.12	128.15	11.32	801.22	6.25	- 258,798.55	0.17334	0.000026	
28	THAI	0.97	129.68	11.39	705.39	5.44	- 195,855.43	0.17312	0.000026	
29	NPC	1.06	104.51	10.22	628.76	6.02	- 239,648.80	0.17079	0.000026	
30	SHANG	1.04	28.30	5.32	192.76	6.81	- 307,277.99	0.14748	0.000022	
31	TPI	1.05	35.45	5.95	357.50	10.08	- 673,608.02	0.10090	0.000015	
32	NFS	1.31	27.79	5.27	388.77	13.99	-1,296,312.10	0.09128	0.000014	
33	MBK	1.00	18.73	4.33	204.13	10.90	- 786,752.74	0.08877	0.000013	
34	AYUD	1.08	896.53	29.94	43.46	- 0.05	880.96	-21.64012	-0.003239	100

ภาคผนวก 12 ตารางสรุป ค่าตัวแปรที่ใช้ในการคำนวณ ณ สิ้นสุดงวดการลงทุนที่ 32 เพื่อพิจารณาการลงทุนในงวดที่ 33 (กันยายน 2543)

No.	Stock	Ri	Var.i	SD.i	Cov.i	Bi	Var.Ei	Gi	Ci	Wi
	SET	0.90	6,594.86	81.21	6,594.86	1.00	-	-	-	-
1	AYUD	0.93	885.66	29.76	13.83	0.02	884.05	57.45252	0.008041	
2	SSC	0.90	6,198.71	78.73	2,256.82	0.36	5,324.54	2.39265	0.000362	
3	DELTA	0.77	18,597.61	136.37	6,467.14	0.35	17,800.14	2.11569	0.000320	
4	SCC	0.80	24,395.67	156.19	8,840.21	0.36	23,529.70	2.10471	0.000318	
5	BKI	0.97	3,223.77	56.78	1,551.64	0.48	1,695.99	1.95545	0.000296	
6	ADVANC	0.87	5,760.37	75.90	3,518.58	0.61	3,299.78	1.36876	0.000208	
7	PTTEP	0.42	8,169.60	90.39	2,367.91	0.29	7,615.57	1.33912	0.000203	
8	SPP	1.01	685.01	26.17	500.87	0.73	2,840.82	1.33806	0.000203	
9	AA	0.99	71.74	8.47	56.55	0.79	4,026.03	1.20845	0.000183	
10	GRAMMY	0.89	2,537.71	50.38	1,819.50	0.72	852.49	1.19750	0.000182	100
11	TUF	1.02	344.58	18.56	343.34	1.00	6,202.90	0.98800	0.000150	
12	EGCOMP	0.90	254.39	15.95	246.63	0.97	5,944.26	0.89862	0.000136	
13	.KRP	0.72	1,586.03	39.82	1,328.53	0.84	3,041.25	0.81880	0.000124	
14	CPF	0.95	1,114.67	33.39	1,289.06	1.16	7,705.14	0.78952	0.000120	
15	BEC	0.87	1,538.45	39.22	1,678.28	1.09	6,309.71	0.76765	0.000116	
16	SCCC	0.82	1,311.57	36.22	1,959.37	1.49	13,406.66	0.52692	0.000080	
17	TUNTEX	0.82	20.17	4.49	43.88	2.18	31,192.22	0.36361	0.000055	



ภาคผนวก 13 ตารางสรุปค่าตัวแปรที่ใช้ในการคำนวณ ต้นทุนคาดการณ์การลงทุนในงวดที่ 51 เพื่อพิจารณาการลงทุนในงวดที่ 52 (เมษายน 2545)

No.	Stock	Ri	Var.i	SD.i	Cov.i	Bi	Var.Ei	Gi	Ci	Wi
	SET	0.99	5,765.23	75.93	5,765.23	1.00	-	-	-	-
1	ADVANC	0.95	15,117.04	122.95	1,924.79	0.13	15,023.57	7.28820	0.001230	
2	SCC	1.02	25,674.32	160.23	8,030.83	0.31	25,110.24	3.20186	0.000551	
3	DELTA	0.90	19,122.92	138.29	6,132.72	0.32	18,529.97	2.74005	0.000473	
4	PTTEP	0.88	13,180.51	114.81	4,721.32	0.36	12,440.77	2.41017	0.000417	
5	BKI	1.00	2,405.93	49.05	1,137.79	0.47	1,116.57	2.07227	0.000359	
6	SSC	0.97	5,111.30	71.49	2,496.87	0.49	3,735.53	1.93847	0.000336	
7	AYUD	1.13	733.40	27.08	528.28	0.72	2,257.92	1.53745	0.000267	46
8	SCCC	1.01	1,156.19	34.00	961.41	0.83	2,830.16	1.19057	0.000207	18
9	GRAMMY	1.05	2,170.23	46.59	2,081.15	0.96	3,131.43	1.07241	0.000186	
10	TUF	0.89	1,642.75	40.53	1,354.50	0.82	2,276.76	1.05825	0.000184	36
11	BEC	0.98	1,118.04	33.44	1,042.13	0.93	3,890.90	1.02718	0.000178	
12	KRP	1.02	1,200.18	34.64	1,354.87	1.13	6,146.97	0.88780	0.000154	
13	SHANG	1.00	29.31	5.41	34.60	1.18	8,004.79	0.83017	0.000144	
14	CPF	0.86	1,116.02	33.41	1,361.85	1.22	7,468.80	0.69135	0.000120	
15	EGCOMP	0.98	221.01	14.87	457.06	2.07	24,435.93	0.46222	0.000080	
16	KBANK	1.14	419.17	20.47	1,248.49	2.98	50,726.21	0.37549	0.000065	
17	PRG	1.30	12.95	3.60	45.33	3.50	70,626.70	0.36692	0.000064	

No.	Stock	Ri	Var.i	SD.i	Cov.i	Bi	Var.Ei	Gi	Ci	Wi
18	MAKRO	1.10	170.55	13.06	518.04	3.04	53,020.65	0.35556	0.000062	
19	BJC	1.04	173.20	13.16	560.28	3.23	60,156.49	0.31440	0.000055	
20	AA	0.95	68.87	8.30	213.62	3.10	55,398.85	0.29823	0.000052	
21	BBL	1.04	339.93	18.44	1,222.28	3.60	74,198.30	0.28379	0.000049	
22	TA	0.80	168.38	12.98	493.03	2.93	49,260.68	0.26742	0.000046	
23	THAI	1.10	189.82	13.78	812.11	4.28	105,336.89	0.25224	0.000044	
24	BECL	1.04	101.94	10.10	420.50	4.12	97,995.89	0.24775	0.000043	
25	NPC	0.90	84.70	9.20	360.54	4.26	104,376.91	0.20742	0.000036	
26	TUNTEX	1.01	28.58	5.35	167.65	5.87	198,352.07	0.16845	0.000029	
27	TISCO	1.03	86.23	9.29	602.34	6.99	281,222.54	0.14512	0.000025	
28	DTC	0.86	67.18	8.20	401.47	5.98	205,826.41	0.14008	0.000024	
29	SUC	1.00	23.58	4.86	177.81	7.54	327,800.91	0.12996	0.000023	
30	MBK	0.97	17.69	4.21	162.88	9.21	488,743.25	0.10360	0.000018	
31	PRECHA	1.00	11.17	3.34	112.51	10.07	584,903.54	0.09729	0.000017	
32	TPI	1.06	31.37	5.60	334.87	10.67	656,930.38	0.09724	0.000017	
33	NFS	1.05	21.15	4.60	314.68	14.88	-1,276,224.21	0.06912	0.000012	
34	SPP	1.03	2,309.87	48.06	726.65	-0.31	1,739.32	-3.21154	-0.000557	100

ภาคผนวก 14 ตารางสรุป ค่าตัวแปรที่ใช้ในการคำนวณ ณ สิ้นสุดงวดการลงทุนที่ 56 เพื่อพิจารณาการลงทุนในงวดที่ 57 (กันยายน 2545)

No.	Stock	Ri	Var.i	SD.i	Cov.i	Bi	Var.Ei	Gi	Ci	Wi
	SET	0.92	5,322.48	72.96	5,322.48	1.00	-	-	-	-
1	ADVANC	1.13	19,443.02	139.44	1,196.09	0.06	19,422.88	18.08818	0.002877	
2	SCC	0.83	42,041.32	205.04	8,360.41	0.20	41,830.84	4.06410	0.000736	
3	DELTA	0.94	21,580.68	146.90	5,104.07	0.24	21,282.95	3.87204	0.000718	
4	PTTEP	1.01	12,986.60	113.96	4,070.61	0.31	12,463.67	3.15268	0.000590	
5	BKI	1.00	2,317.41	48.14	1,120.79	0.48	1,072.45	2.02630	0.000381	
6	TUF	1.05	2,010.10	44.83	1,064.27	0.53	518.05	1.95334	0.000367	
7	SSC	0.93	5,195.28	72.08	2,465.08	0.47	3,997.00	1.91212	0.000359	
8	SCCC	0.97	1,809.58	42.54	1,101.02	0.61	160.79	1.55985	0.000293	100
9	AYUD	0.99	696.64	26.39	517.00	0.74	2,234.78	1.31068	0.000246	
10	GRAMMY	0.89	2,416.15	49.15	2,000.39	0.83	1,232.19	1.04498	0.000196	
11	CPF	0.90	1,194.70	34.56	1,140.50	0.95	3,655.80	0.92550	0.000174	
12	BEC	0.88	1,053.79	32.46	987.70	0.94	3,622.01	0.91455	0.000172	
13	KRP	0.93	1,125.93	33.55	1,190.20	1.06	4,821.52	0.86184	0.000162	
14	SHANG	0.97	27.18	5.21	36.51	1.34	9,576.52	0.70475	0.000132	
15	EGCOMP	0.95	203.07	14.25	410.23	2.02	21,517.81	0.46186	0.000087	
16	TA	0.87	174.63	13.21	414.93	2.38	29,874.09	0.35680	0.000067	
17	MAKRO	0.96	168.04	12.96	446.05	2.65	37,334.08	0.35567	0.000067	



No.	Stock	Ri	Var.i	SD.i	Cov.i	Bi	Var.Ei	Gi	Ci	Wi
18	AA	0.99	64.15	8.01	186.33	2.90 -	44,839.98	0.33309	0.000063	
19	KBANK	0.90	389.46	19.73	1,118.32	2.87 -	43,495.98	0.30578	0.000057	
20	PRG	1.00	14.72	3.84	50.83	3.45 -	63,450.92	0.28380	0.000053	
21	BJC	0.94	160.28	12.66	522.35	3.26 -	56,369.67	0.28153	0.000053	
22	NPC	0.93	108.93	10.44	372.57	3.42 -	62,154.75	0.26585	0.000050	
23	BBL	0.83	314.83	17.74	1,133.86	3.60 -	68,721.98	0.22583	0.000042	
24	BECL	0.87	93.01	9.64	380.83	4.09 -	89,138.26	0.20807	0.000039	
25	TUNTEX	0.90	28.80	5.37	140.31	4.87 -	126,301.15	0.17998	0.000034	
26	DTC	1.02	62.44	7.90	373.99	5.99 -	190,882.53	0.16698	0.000031	
27	THAI	0.68	173.83	13.18	734.58	4.23 -	94,874.13	0.15676	0.000029	
28	MBK	1.01	21.18	4.60	164.64	7.77 -	321,591.26	0.12713	0.000024	
29	SUC	0.95	21.60	4.65	164.94	7.64 -	310,333.24	0.12175	0.000023	
30	TISCO	0.85	81.64	9.04	562.64	6.89 -	252,713.81	0.12001	0.000023	
31	PRECHA	1.00	11.17	3.34	112.51	10.07 -	539,984.08	0.09729	0.000018	
32	TPI	0.70	29.42	5.42	297.91	10.13 -	545,727.01	0.06746	0.000013	
33	NFS	0.89	20.86	4.57	297.27	14.25 -	1,080,884.32	0.06114	0.000011	
34	SPP	0.96	3,258.64	57.08	421.66	- 0.13	3,169.52	- 7.30172	-0.001363	100

ภาคผนวก 15 ตารางแสดงการคำนวณการวัดประสิทธิภาพกลุ่มหลักทรัพย์ลงทุนตามวิธีของ Sharpe

งวด	เดือน ปี	สินทรัพย์	Ri	Wi	sigma i	beta i	sigma ei^2	Rp	sigma p	Sp	Sm
1	Jan-41	Market	1.23	-	134.64	1.00	-	-	-	-	-
22	Oct-42	Market BJC	1.02 0.91	- 1.00	89.84 11.54	1.00 2.78	- 3.34	- 12.48	- 8.12	1.53 -	1.29 -
27	Mar-43	Market GRAMMY	1.07 1.24	- 1.00	84.77 53.62	1.00 0.61	- 173.48	- 10.48	- 11.48	0.92 -	1.85 -
32	Aug-43	Market GRAMMY AA KRP	1.08 1.02 0.99 0.84	- 0.67 0.21 0.12	81.39 50.77 8.49 40.27	1.00 0.69 0.54 0.81	- 612.49 -1,853.56 -2,738.95	- 16.23 - -	- 12.73 - -	1.28 - - -	2.29 - - -
33	Sep-43	Market	0.90	-	81.21	1.00	-	-	-	0.03	0.63
51	Apr-45	Market AYUD TUF SCCC	0.99 1.13 0.89 1.01	- 0.46 0.36 0.18	75.93 27.08 40.53 34.00	1.00 0.72 0.82 0.83	- -2,257.92 -2,276.76 -2,830.16	- 4.21 - -	- 10.33 - -	0.40 - - -	0.86 - - -
57	Sep-45	Market SCCC	0.92 0.97	- 1.00	72.96 42.54	1.00 0.61	- -160.79	- 2.10	- 9.53	0.22 -	1.68 -



ภาคผนวก 16 ตารางแสดงการคำนวณการวัดประสิทธิภาพกลุ่มหลักทรัพย์ของ Treynor

งวด	เดือน ปี	สินทรัพย์	Ri	Wi	sigma i	beta i	sigma ei <sup>2</sup>	Rp	beta p	Tp	Tm
1	Jan-41	Market	1.23	-	134.64	1.00	-	-	-	-	-
22	Oct-42	Market BJC	1.02 0.91	- 1.00	89.84 11.54	1.00 2.78	- 3.34	- 12.48	- -0.49	25.59	10.20
27	Mar-43	Market GRAMMY	1.07 1.24	- 1.00	84.77 53.62	1.00 0.61	- 173.48	- 10.48	- 0.17	63.35	15.91
32	Aug-43	Market GRAMMY AA KRP	1.08 1.02 0.99 0.84	- 0.67 0.21 0.12	81.39 50.77 8.49 40.27	1.00 0.69 0.54 0.81	- -612.49 -1,853.56 -2,738.95	- 16.23	- 0.41	39.44	23.98
33	Sep-43	Market	0.90	-	81.21	1.00	-	-	-	0.57	8.10
51	Apr-45	Market AYUD TUF SCCC	0.99 1.13 0.89 1.01	- 0.46 0.36 0.18	75.93 27.08 40.53 34.00	1.00 0.72 0.82 0.83	- -2,257.92 -2,276.76 -2,830.16	- 4.21	- 0.48	8.71	9.95
57	Sep-45	Market SCCC	0.92 0.97	- 1.00	72.96 42.54	1.00 0.61	- -160.79	- 2.10	- 0.67	3.09	30.23