

ภาคผนวก

ภาคผนวก ก

อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

อัตราผลตอบแทนต่อเดือนของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ระหว่างปี พ.ศ.2546 – 2550

เดือน	อัตราผลตอบแทนต่อเดือน				
	2546	2547	2548	2549	2550
มกราคม	4.57	-9.21	5.49	7.29	-3.15
กุมภาพันธ์	-1.44	2.82	6.13	-1.97	4.21
มีนาคม	1.93	-9.23	-7.58	-0.91	0.15
เมษายน	3.77	0.58	-2.73	5.31	4.41
พฤษภาคม	8.69	-0.65	1.91	-7.11	6.04
มิถุนายน	15.09	1.32	1.77	-3.80	5.85
กรกฎาคม	5.41	-1.09	0.60	2.60	11.12
สิงหาคม	11.63	-1.44	3.83	0.53	-5.00
กันยายน	8.14	3.67	4.15	-0.08	4.39
ตุลาคม	10.83	-2.12	-5.09	5.89	7.68
พฤศจิกายน	1.39	4.98	-1.62	2.84	-6.33
ธันวาคม	19.81	2.15	7.39	-7.44	1.77
SUM	89.81	-8.22	14.25	3.16	31.14
SUM/12	7.48	-0.69	1.19	0.26	2.60

ส่วนเบี่ยงเบนมาตรฐานเฉลี่ยต่อเดือนของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ระหว่างปี
พ.ศ.2546 -2550

เดือน	ส่วนเบี่ยงเบนมาตรฐานเฉลี่ยต่อเดือน				
	2546	2547	2548	2549	2550
มกราคม	0.71	6.05	1.54	4.12	2.75
กุมภาพันธ์	6.64	1.02	2.03	0.42	0.22
มีนาคม	2.57	6.09	6.40	0.11	0.50
เมษายน	1.15	0.13	1.28	2.12	0.27
พฤษภาคม	0.12	0.00	0.04	4.54	0.99
มิถุนายน	4.82	0.33	0.03	1.38	0.88
กรกฎาคม	0.36	0.01	0.03	0.45	6.05
สิงหาคม	1.43	0.05	0.58	0.01	4.81
กันยายน	0.04	1.58	0.73	0.01	0.27
ตุลาคม	0.93	0.17	3.29	2.64	2.16
พฤศจิกายน	3.10	2.68	0.66	0.56	6.64
ธันวาคม	12.67	0.67	3.21	4.94	0.06
SUM	34.53	18.79	19.82	21.29	25.60
SUM/12	5.88	4.33	4.45	4.61	5.06

ภาคผนวก ข

อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงของหลักทรัพย์หมวดธุรกิจพัฒนาอสังหาริมทรัพย์

อัตราผลตอบแทนต่อเดือนของหลักทรัพย์หมวดธุรกิจพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ ระหว่างปี
พ.ศ.2546 – 2550

เดือน	อัตราผลตอบแทนต่อเดือน				
	2546	2547	2548	2549	2550
มกราคม	4.41	-12.14	8.56	12.20	-8.26
กุมภาพันธ์	-10.26	1.67	-0.72	0.22	5.57
มีนาคม	0.74	-9.43	-8.15	-2.35	-1.35
เมษายน	3.12	-8.54	-12.51	3.19	5.32
พฤษภาคม	7.39	-10.03	5.98	-13.38	2.94
มิถุนายน	14.15	-2.89	-2.71	-5.04	5.29
กรกฎาคม	4.20	-6.15	-4.43	1.25	11.09
สิงหาคม	33.24	-3.19	2.69	1.33	-7.91
กันยายน	15.64	1.50	8.87	2.01	2.45
ตุลาคม	11.37	-7.99	-4.21	11.21	1.12
พฤศจิกายน	-1.23	7.88	-3.74	5.36	-3.72
ธันวาคม	8.01	0.26	6.92	-10.95	1.49
SUM	90.79	-49.05	-3.45	5.06	14.02
SUM/12	7.57	-4.09	-0.29	0.42	1.17

ส่วนเบี่ยงเบนมาตรฐานเฉลี่ยต่อเดือนของหลักทรัพย์หมวดธุรกิจพัฒนาอสังหาริมทรัพย์
ระหว่างปี พ.ศ.2546 -2550

เดือน	ส่วนเบี่ยงเบนมาตรฐานเฉลี่ยต่อเดือน				
	2546	2547	2548	2549	2550
มกราคม	0.83	5.41	6.52	11.57	7.40
กุมภาพันธ์	26.48	2.76	0.02	0.00	1.61
มีนาคม	3.88	2.38	5.15	0.64	0.53
เมษายน	1.65	1.65	12.45	0.64	1.43
พฤษภาคม	0.0024	2.94	3.27	15.88	0.26
มิถุนายน	3.62	0.12	0.49	2.49	1.41
กรกฎาคม	0.95	0.35	1.43	0.06	8.20
สิงหาคม	54.93	0.07	0.74	0.07	6.88
กันยายน	5.44	2.60	6.98	0.21	0.14
ตุลาคม	1.21	1.27	1.28	9.70	0.00
พฤศจิกายน	6.45	11.92	0.99	2.03	1.99
ธันวาคม	0.02	1.58	4.33	10.78	0.01
SUM	105.44	33.05	43.65	54.06	29.87
SUM/12	10.27	5.75	6.61	7.35	5.47

ภาคผนวก ค

ผลการวิเคราะห์ปัจจัยที่ส่งผลให้เกิดการเปลี่ยนแปลงต่อราคาหลักทรัพย์หมวดธุรกิจพัฒนา
อสังหาริมทรัพย์

Regression

Variables Entered/Removed(b)

Model	Variables Entered	Variables Removed	Method
1	INF, PBV, MLR, II(a)		Enter

a. All requested variables entered.

b. Dependent Variable: L-PROP

Model Summary

Model	R	R Square	Adjusted R Square	Std. Error of the Estimate
1	0.990	0.981	0.979	3.60245

a. Predictors: (Constant), INF, PBV, MLR, II

ANOVA(b)

Model		Sum of Squares	df	Mean Square	F	Sig.
1	Regression	36,427.932	4	9,106.983	701.745	0.000
	Residual	713.770	55	12.978		
	Total	37,141.702	59			

a. Predictors: (Constant), INF, PBV, MLR, II

b. Dependent Variable: L-PROP

Coefficients(a)

Model		Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients	t	Sig.
		B	Std. Error	Beta		
1	(Constant)	-122.034	14.932		-8.173	0.000
	MLR	-1.057	1.165	-0.032	-0.907	0.368
	PBV	61.506	1.242	1.098	49.519	0.000
	II	0.309	0.072	0.203	4.321	0.000
	INF	0.767	0.264	0.182	2.908	0.005