



ภาคผนวก

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

ตารางภาคผนวก ก 1 Autocorrelation และ Partial Correlation ของหลักทรัพย์ THAI

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
		1	0.051	0.051	0.6766	0.411
		2	-0.045	-0.048	1.2230	0.543
		3	-0.065	-0.060	2.3399	0.505
		4	-0.052	-0.048	3.0653	0.547
		5	0.052	0.052	3.8001	0.579
		6	-0.005	-0.019	3.8063	0.703
		7	0.018	0.017	3.8892	0.792
		8	-0.057	-0.057	4.7619	0.783
		9	-0.008	0.004	4.7784	0.853
		10	0.066	0.060	5.9477	0.820
		11	0.045	0.035	6.4929	0.839
		12	-0.103	-0.112	9.4071	0.668
		13	0.030	0.059	9.6533	0.722
		14	0.005	0.002	9.6617	0.786
		15	0.070	0.063	11.010	0.752
		16	-0.073	-0.097	12.493	0.709
		17	-0.079	-0.051	14.258	0.649
		18	0.022	0.030	14.398	0.703
		19	-0.061	-0.060	15.441	0.694
		20	0.043	0.011	15.978	0.718
		21	-0.051	-0.060	16.727	0.727
		22	0.025	0.047	16.904	0.769
		23	-0.009	-0.010	16.929	0.813
		24	-0.012	-0.027	16.972	0.850
		25	0.054	0.041	17.809	0.850
		26	-0.043	-0.036	18.358	0.862
		27	0.041	0.069	18.842	0.876
		28	0.009	-0.015	18.865	0.902
		29	0.034	0.034	19.209	0.916
		30	-0.048	-0.047	19.901	0.919
		31	0.051	0.077	20.690	0.920
		32	0.074	0.075	22.338	0.898
		33	0.081	0.054	24.283	0.865
		34	0.007	0.021	24.299	0.890
		35	-0.048	-0.041	24.995	0.895
		36	-0.136	-0.128	30.620	0.722
		37	-0.048	-0.026	31.328	0.732
		38	0.007	-0.045	31.343	0.769
		39	0.022	0.033	31.494	0.798
		40	0.114	0.085	35.492	0.673
		41	-0.095	-0.075	38.297	0.591
		42	0.000	-0.015	38.297	0.634
		43	0.090	0.113	40.847	0.565
		44	0.016	0.007	40.933	0.604
		45	-0.054	-0.067	41.857	0.606

ที่มา: จากการคำนวณ

ตารางภาคผนวก ก 2 Autocorrelation และ Partial Correlation ของหลักทรัพย์ TTA

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
		1	0.157	0.157	6.4894	0.011
		2	-0.083	-0.111	8.3138	0.016
		3	-0.022	0.010	8.4465	0.038
		4	-0.056	-0.065	9.2827	0.054
		5	0.177	0.205	17.654	0.003
		6	0.152	0.079	23.881	0.001
		7	0.018	0.017	23.969	0.001
		8	-0.009	0.001	23.991	0.002
		9	-0.010	0.019	24.018	0.004
		10	0.105	0.095	27.032	0.003
		11	0.112	0.044	30.456	0.001
		12	0.074	0.056	31.978	0.001
		13	0.150	0.154	38.143	0.000
		14	0.072	0.059	39.570	0.000
		15	-0.062	-0.080	40.637	0.000
		16	-0.215	-0.254	53.511	0.000
		17	-0.087	-0.066	55.640	0.000
		18	-0.117	-0.236	59.489	0.000
		19	0.095	0.073	62.018	0.000
		20	0.012	-0.112	62.057	0.000
		21	-0.099	0.008	64.867	0.000
		22	-0.136	-0.134	70.123	0.000
		23	-0.146	-0.103	76.230	0.000
		24	0.144	0.137	82.229	0.000
		25	0.124	0.058	86.678	0.000
		26	-0.004	0.104	86.683	0.000
		27	-0.139	-0.059	92.307	0.000
		28	-0.167	0.069	100.53	0.000
		29	-0.087	0.000	102.78	0.000
		30	-0.034	-0.032	103.13	0.000
		31	-0.022	-0.008	103.28	0.000
		32	0.054	0.053	104.14	0.000
		33	-0.014	0.048	104.20	0.000
		34	0.068	0.060	105.60	0.000
		35	0.035	0.078	105.97	0.000
		36	-0.059	-0.091	107.04	0.000
		37	0.013	-0.010	107.08	0.000
		38	0.067	-0.064	108.48	0.000
		39	0.076	0.016	110.28	0.000
		40	-0.096	-0.098	113.11	0.000
		41	-0.061	0.030	114.26	0.000
		42	-0.041	0.023	114.80	0.000
		43	0.003	-0.082	114.80	0.000
		44	0.010	-0.123	114.83	0.000
		45	0.061	-0.064	116.03	0.000

ที่มา: จากการคำนวณ

ตารางภาคผนวก ก 3 Autocorrelation และ Partial Correlation ของหลักทรัพย์ PSL

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
		1	-0.173	-0.173	7.8230	0.005
		2	-0.049	-0.081	8.4531	0.015
		3	-0.054	-0.081	9.2352	0.026
		4	-0.019	-0.051	9.3357	0.053
		5	0.157	0.140	15.864	0.007
		6	0.134	0.194	20.696	0.002
		7	-0.030	0.059	20.940	0.004
		8	-0.043	0.003	21.428	0.006
		9	0.036	0.056	21.771	0.010
		10	0.118	0.123	25.519	0.004
		11	-0.112	-0.127	28.955	0.002
		12	0.037	-0.030	29.320	0.004
		13	0.138	0.166	34.560	0.001
		14	0.075	0.143	36.094	0.001
		15	-0.045	-0.049	36.651	0.001
		16	-0.132	-0.150	41.483	0.000
		17	-0.067	-0.090	42.746	0.001
		18	-0.185	-0.353	52.395	0.000
		19	0.290	0.038	76.025	0.000
		20	-0.099	-0.097	78.781	0.000
		21	-0.071	-0.018	80.205	0.000
		22	0.004	0.060	80.211	0.000
		23	-0.111	-0.039	83.766	0.000
		24	0.056	0.061	84.678	0.000
		25	0.000	-0.013	84.678	0.000
		26	0.070	0.140	86.099	0.000
		27	-0.030	0.046	86.357	0.000
		28	-0.066	0.041	87.645	0.000
		29	-0.001	0.020	87.645	0.000
		30	-0.114	0.003	91.498	0.000
		31	0.011	0.010	91.534	0.000
		32	0.064	-0.046	92.742	0.000
		33	-0.027	-0.071	92.955	0.000
		34	0.107	0.065	96.373	0.000
		35	0.037	0.147	96.796	0.000
		36	-0.138	-0.183	102.55	0.000
		37	0.046	0.101	103.19	0.000
		38	0.055	-0.037	104.12	0.000
		39	0.076	0.028	105.89	0.000
		40	-0.040	-0.097	106.39	0.000
		41	-0.050	-0.118	107.17	0.000
		42	-0.062	0.058	108.38	0.000
		43	0.069	0.019	109.85	0.000
		44	-0.024	-0.038	110.03	0.000
		45	0.045	-0.043	110.67	0.000

ที่มา: จากการคำนวณ

ตารางภาคผนวก ก 4 Autocorrelation และ Partial Correlation ของหลักทรัพย์ BECL

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
		1	0.021	0.021	0.1204	0.729
		2	0.121	0.121	3.9970	0.136
		3	-0.062	-0.068	5.0289	0.170
		4	-0.119	-0.133	8.7670	0.067
		5	0.145	0.173	14.390	0.013
		6	-0.041	-0.024	14.847	0.021
		7	0.062	0.003	15.880	0.026
		8	-0.078	-0.068	17.510	0.025
		9	-0.035	-0.004	17.838	0.037
		10	-0.002	-0.008	17.839	0.058
		11	0.066	0.086	19.018	0.061
		12	0.102	0.068	21.864	0.039
		13	-0.009	-0.021	21.886	0.057
		14	-0.014	-0.028	21.941	0.080
		15	-0.011	0.034	21.973	0.109
		16	-0.038	-0.043	22.368	0.132
		17	0.079	0.054	24.102	0.117
		18	0.030	0.037	24.358	0.144
		19	0.019	0.004	24.463	0.179
		20	-0.003	-0.004	24.466	0.223
		21	-0.039	-0.003	24.901	0.251
		22	0.031	0.013	25.176	0.289
		23	-0.051	-0.065	25.934	0.304
		24	-0.025	-0.048	26.110	0.348
		25	-0.012	0.017	26.150	0.400
		26	-0.054	-0.036	27.002	0.409
		27	0.133	0.131	32.143	0.227
		28	0.066	0.085	33.431	0.220
		29	0.089	0.031	35.793	0.180
		30	-0.089	-0.128	38.125	0.147
		31	-0.082	-0.046	40.135	0.126
		32	0.012	0.030	40.181	0.152
		33	-0.062	-0.057	41.318	0.152
		34	-0.032	-0.103	41.636	0.173
		35	-0.062	0.002	42.799	0.171
		36	-0.039	0.004	43.271	0.189
		37	0.032	0.046	43.579	0.212
		38	-0.032	-0.047	43.888	0.236
		39	-0.012	-0.078	43.936	0.270
		40	0.024	0.022	44.107	0.302
		41	-0.028	0.012	44.347	0.332
		42	0.059	0.060	45.424	0.331
		43	-0.050	-0.036	46.216	0.341
		44	0.022	0.007	46.370	0.375
		45	-0.091	-0.085	48.976	0.317

ที่มา: จากการคำนวณ

ตารางภาคผนวก ข 1 Correlogram of Standardized Residuals Squared ของหลักทรัพย์ THAI

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
		1	0.036	0.036	0.3017	
		2	0.004	0.003	0.3057	
		3	-0.048	-0.048	0.8255	0.364
		4	0.049	0.053	1.3888	0.499
		5	0.072	0.069	2.5742	0.462
		6	0.033	0.026	2.8314	0.586
		7	-0.059	-0.058	3.6426	0.602
		8	0.041	0.049	4.0282	0.673
		9	0.099	0.094	6.3167	0.503
		10	0.101	0.082	8.7112	0.367
		11	0.014	0.013	8.7611	0.460
		12	0.025	0.037	8.9161	0.540
		13	0.044	0.042	9.3816	0.587
		14	-0.025	-0.054	9.5275	0.657
		15	0.034	0.025	9.8087	0.709
		16	0.036	0.041	10.132	0.753
		17	0.013	0.001	10.172	0.809
		18	0.094	0.080	12.352	0.719
		19	0.130	0.121	16.538	0.486
		20	0.065	0.050	17.574	0.484
		21	0.104	0.093	20.297	0.377
		22	-0.087	-0.098	22.199	0.330
		23	0.024	0.016	22.348	0.380
		24	0.015	0.000	22.408	0.436
		25	0.030	-0.005	22.633	0.482
		26	-0.028	-0.034	22.830	0.530
		27	0.037	0.030	23.177	0.567
		28	-0.030	-0.067	23.415	0.609
		29	0.037	-0.019	23.777	0.643
		30	-0.066	-0.094	24.919	0.632
		31	-0.016	-0.039	24.983	0.679
		32	-0.003	0.001	24.987	0.726
		33	0.060	0.044	25.943	0.724
		34	-0.102	-0.121	28.738	0.632
		35	0.055	0.077	29.543	0.640
		36	0.051	0.036	30.239	0.653
		37	0.074	0.029	31.712	0.628
		38	0.036	0.033	32.057	0.657
		39	-0.006	-0.009	32.067	0.699
		40	-0.037	-0.032	32.439	0.724
		41	0.023	0.026	32.583	0.756
		42	0.009	-0.008	32.603	0.791
		43	-0.060	-0.037	33.610	0.787
		44	-0.043	-0.042	34.137	0.801
		45	0.010	-0.002	34.165	0.830

ที่มา: จากการคำนวณ

ตารางภาคผนวก ข 2 Correlogram of Standardized Residuals Squared ของหลักทรัพย์ TTA

	Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob
1	-0.036	-0.036	0.3333			
2	-0.048	-0.050	0.9461	0.331		
3	0.014	0.011	1.0007	0.606		
4	-0.026	-0.028	1.1819	0.757		
5	0.035	0.035	1.5183	0.823		
6	0.004	0.004	1.5224	0.910		
7	0.061	0.066	2.5398	0.864		
8	-0.026	-0.023	2.7294	0.909		
9	0.000	0.007	2.7294	0.950		
10	0.026	0.021	2.9179	0.967		
11	0.009	0.015	2.9403	0.983		
12	0.052	0.050	3.6849	0.978		
13	-0.014	-0.009	3.7421	0.988		
14	-0.031	-0.030	4.0145	0.991		
15	0.035	0.032	4.3493	0.993		
16	0.013	0.013	4.3933	0.996		
17	0.032	0.030	4.6742	0.997		
18	-0.017	-0.017	4.7593	0.998		
19	-0.026	-0.027	4.9510	0.999		
20	-0.017	-0.020	5.0350	0.999		
21	0.060	0.060	6.0656	0.999		
22	0.026	0.018	6.2600	0.999		
23	-0.030	-0.023	6.5140	0.999		
24	0.010	0.005	6.5455	1.000		
25	-0.023	-0.017	6.6924	1.000		
26	-0.036	-0.035	7.0657	1.000		
27	0.044	0.032	7.6200	1.000		
28	-0.023	-0.032	7.7738	1.000		
29	-0.023	-0.022	7.9355	1.000		
30	0.044	0.047	8.5117	1.000		
31	-0.030	-0.026	8.7830	1.000		
32	-0.031	-0.034	9.0703	1.000		
33	0.004	-0.004	9.0757	1.000		
34	-0.018	-0.024	9.1754	1.000		
35	-0.033	-0.023	9.5007	1.000		
36	-0.004	-0.006	9.5047	1.000		
37	0.037	0.028	9.9259	1.000		
38	-0.029	-0.023	10.189	1.000		
39	0.005	0.007	10.197	1.000		
40	-0.030	-0.028	10.484	1.000		
41	-0.032	-0.020	10.802	1.000		
42	0.004	-0.009	10.807	1.000		
43	-0.039	-0.039	11.285	1.000		
44	-0.029	-0.032	11.550	1.000		
45	-0.005	-0.007	11.557	1.000		

ที่มา: จากการคำนวณ

ตารางภาคผนวก ข 3 Correlogram of Standardized Residuals Squared ของหลักทรัพย์ PSL

	Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob
1	-0.026	-0.026	0.1789			
2	-0.037	-0.037	0.5296	0.467		
3	-0.039	-0.041	0.9231	0.630		
4	-0.030	-0.033	1.1559	0.764		
5	0.066	0.061	2.3041	0.680		
6	0.101	0.102	5.0327	0.412		
7	-0.023	-0.015	5.1792	0.521		
8	-0.033	-0.023	5.4677	0.603		
9	-0.030	-0.022	5.7033	0.680		
10	-0.018	-0.021	5.7874	0.761		
11	0.232	0.217	20.450	0.025		
12	-0.031	-0.031	20.717	0.036		
13	-0.017	-0.001	20.801	0.053		
14	-0.020	-0.002	20.908	0.075		
15	-0.010	0.004	20.937	0.103		
16	-0.001	-0.028	20.937	0.139		
17	0.037	-0.005	21.328	0.166		
18	-0.014	-0.002	21.382	0.210		
19	-0.006	0.007	21.390	0.260		
20	-0.029	-0.021	21.635	0.303		
21	-0.004	0.003	21.638	0.360		
22	-0.006	-0.063	21.650	0.420		
23	0.000	0.009	21.650	0.481		
24	0.011	0.013	21.685	0.539		
25	-0.032	-0.029	21.980	0.580		
26	0.010	0.014	22.011	0.635		
27	-0.031	-0.024	22.291	0.673		
28	0.002	-0.004	22.292	0.722		
29	0.000	-0.001	22.292	0.768		
30	-0.020	-0.025	22.406	0.803		
31	-0.004	0.009	22.411	0.839		
32	-0.020	-0.025	22.532	0.866		
33	-0.037	-0.020	22.951	0.880		
34	0.075	0.072	24.657	0.852		
35	-0.025	-0.033	24.838	0.874		
36	-0.016	0.000	24.920	0.897		
37	-0.011	-0.019	24.959	0.917		
38	-0.034	-0.017	25.310	0.927		
39	-0.005	-0.011	25.319	0.943		
40	0.088	0.077	27.726	0.911		
41	-0.019	-0.005	27.835	0.927		
42	-0.014	-0.012	27.895	0.941		
43	-0.019	-0.004	28.012	0.952		
44	-0.034	-0.015	28.380	0.958		
45	0.001	-0.053	28.381	0.967		

ที่มา: จากการคำนวณ

ตารางภาคผนวก ข 4 Correlogram of Standardized Residuals Squared ของหลักทรัพย์ BECL

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
		1	-0.073	-0.073	1.4127	
		2	-0.078	-0.084	3.0291	0.082
		3	0.062	0.051	4.0621	0.131
		4	0.019	0.022	4.1612	0.245
		5	0.013	0.026	4.2081	0.379
		6	-0.026	-0.024	4.3925	0.494
		7	-0.018	-0.022	4.4800	0.612
		8	0.119	0.111	8.3112	0.306
		9	-0.040	-0.024	8.7358	0.365
		10	0.078	0.096	10.377	0.321
		11	0.009	0.005	10.400	0.406
		12	-0.043	-0.030	10.897	0.452
		13	0.004	-0.013	10.902	0.537
		14	0.092	0.090	13.258	0.428
		15	-0.026	-0.010	13.450	0.491
		16	-0.065	-0.066	14.646	0.477
		17	-0.037	-0.051	15.028	0.523
		18	0.065	0.027	16.231	0.507
		19	0.025	0.035	16.404	0.564
		20	0.054	0.083	17.221	0.575
		21	0.084	0.102	19.239	0.506
		22	-0.033	-0.037	19.559	0.549
		23	-0.034	-0.034	19.889	0.590
		24	-0.021	-0.050	20.021	0.641
		25	0.002	0.006	20.023	0.695
		26	-0.037	-0.032	20.422	0.724
		27	-0.022	-0.013	20.564	0.764
		28	-0.017	-0.062	20.646	0.803
		29	0.000	-0.032	20.646	0.840
		30	-0.010	0.001	20.674	0.871
		31	-0.089	-0.091	23.049	0.813
		32	-0.031	-0.044	23.327	0.837
		33	0.031	0.011	23.624	0.858
		34	-0.016	-0.004	23.704	0.883
		35	-0.086	-0.090	25.936	0.838
		36	-0.038	-0.023	26.384	0.853
		37	0.013	0.016	26.433	0.878
		38	-0.075	-0.077	28.172	0.851
		39	0.070	0.072	29.669	0.831
		40	-0.029	-0.034	29.921	0.852
		41	0.042	0.055	30.460	0.862
		42	-0.061	-0.066	31.641	0.853
		43	-0.050	-0.031	32.437	0.856
		44	-0.017	-0.039	32.530	0.878
		45	0.002	0.034	32.532	0.899

ที่มา: จากการคำนวณ

ตารางภาคผนวก ค 1 สถานการณ์จำลองการซื้อขายหลักทรัพย์ THAI ด้วยการวิเคราะห์ทางเทคนิค

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
2/1/2000	56.50							51.17		
9/1/2000	52.50							40.9		
16/1/2000	54.50							47.03		
23/1/2000	52.50							42		
30/1/2000	52.50							42		
6/2/2000	51.50							39.21		
13/2/2000	42.75							23.46		
20/2/2000	42.75							23.46	-4275.00	100
27/2/2000	42.00							22.44	-4200.00	200
5/3/2000	34.75							15.07	-3475.00	300
12/3/2000	36.25							21.24	-3625.00	400
19/3/2000	41.00							37.77	-4100.00	500
26/3/2000	43.75							45.42		
2/4/2000	44.00							46.11		
9/4/2000	44.25							46.89		
16/4/2000	45.00							49.43		
23/4/2000	41.75							39.91		
30/4/2000	41.00							37.96		
7/5/2000	41.00							37.96		
14/5/2000	38.75							31.77		
21/5/2000	39.00							33.17		
28/5/2000	39.50							36.18		
4/6/2000	38.50							32.77		
11/6/2000	38.50							32.77		
18/6/2000	37.75							29.95		
25/6/2000	38.50							36.28		
2/7/2000	36.25							27.63		

ตารางภาคผนวก ค 1 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
9/7/2000	40.75							53.31	-4075.00	600
16/7/2000	40.00							49.90		
23/7/2000	38.75							44.44		
30/7/2000	39.00							45.81		
6/8/2000	40.50							53.70		
13/8/2000	40.50							53.70		
20/8/2000	41.25							57.79		
27/8/2000	39.00							44.26		
3/9/2000	37.50							37.50		
10/9/2000	34.25							27.14		
17/9/2000	34.50	38.06	27.16	3.56	7.34			28.88	-3450.00	700
24/9/2000	34.00	39.59	29.44	5.59	4.56			27.37	-3400.00	800
1/10/2000	34.50	37.50	28.89	3.00	5.61			31.51	-3450.00	900
8/10/2000	33.25	37.88	29.31	4.63	3.94			27.06		
15/10/2000	30.00	35.56	26.77	5.56	3.23			19.01	-3000.00	1000
22/10/2000	31.75	33.73	23.02	1.98	8.73			31.64	-3175.00	1100
29/10/2000	31.75	37.11	25.12	5.36	6.63			31.64		
5/11/2000	33.25	35.46	26.87	2.21	6.38			41.97		
12/11/2000	33.50	35.56	26.77	2.06	6.73			43.61		
19/11/2000	33.50	38.02	28.87	4.52	4.63			43.61		
26/11/2000	33.00	37.39	28.61	4.39	4.39			40.56		
3/12/2000	32.00	36.91	28.35	4.91	3.65			34.93		
10/12/2000	32.25	36.60	27.99	4.35	4.26			37.43		
17/12/2000	32.00	36.09	27.41	4.09	4.59			35.84		
24/12/2000	32.00	35.16	26.59	3.16	5.41			35.84		
31/12/2000	32.00	34.60	26.03	2.60	5.97			35.84		
7/1/2001	34.00	34.72	26.13	0.72	7.87			57.88		

ตารางภาคผนวก ค 1 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
14/1/2001	37.25	38.66	29.57	1.41	7.68			74.38		
21/1/2001	36.50	40.83	29.93	4.33	6.57			67.35	40150.00	0
28/1/2001	36.25	42.84	31.23	6.59	5.02			64.99		
4/2/2001	36.00	39.33	30.39	3.33	5.61			62.47		
11/2/2001	34.75	38.82	30.24	4.07	4.51			51.02		
18/2/2001	32.00	36.95	28.09	4.95	3.91			34.83		
25/2/2001	31.50	35.97	25.70	4.47	5.80			32.65		
4/3/2001	30.50	35.58	24.71	5.08	5.79			28.54		
11/3/2001	30.25	32.49	23.68	2.24	6.57			27.54	-3025.00	100
18/3/2001	28.75	35.96	27.09	7.21	1.66			22.16	-2875.00	200
25/3/2001	28.25	31.24	22.46	2.99	5.79			20.61	-2825.00	300
1/4/2001	28.00	31.81	22.97	3.81	5.03			19.81	-2800.00	400
8/4/2001	27.00	31.39	22.67	4.39	4.33			16.81	-2700.00	500
15/4/2001	27.25	31.17	22.41	3.92	4.84			20.30	-2725.00	600
22/4/2001	27.00	30.23	21.36	3.23	5.64			19.36	-2700.00	700
29/4/2001	27.25	30.68	22.08	3.43	5.17			23.44	-2725.00	800
6/5/2001	31.75	31.22	22.63	-0.53	9.12			62.65	-3175.00	900
13/5/2001	31.50	36.67	25.75	5.17	5.75			60.66		
20/5/2001	29.25	38.31	24.93	9.06	4.32			45.60		
27/5/2001	30.25	34.76	25.03	4.51	5.22			51.75		
3/6/2001	29.00	37.73	26.80	8.73	2.20			44.50		
10/6/2001	28.25	34.69	25.61	6.44	2.64			40.57		
17/6/2001	28.50	34.44	25.26	5.94	3.24			42.52		
24/6/2001	28.00	34.22	25.52	6.22	2.48			39.52		
1/7/2001	27.75	32.56	23.86	4.81	3.89			37.98		
8/7/2001	28.50	33.59	24.74	5.09	3.76			45.37		
15/7/2001	27.25	33.81	25.20	6.56	2.05			36.91		

ตารางภาคผนวก ค 1 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
22/7/2001	26.75	32.00	23.16	5.25	3.59			33.98		
29/7/2001	27.00	33.03	24.10	6.03	2.90			36.87		
5/8/2001	27.00	32.97	24.34	5.97	2.66			36.87		
12/8/2001	27.25	33.17	24.62	5.92	2.63			40.34		
19/8/2001	28.50	33.52	24.96	5.02	3.54			54.71		
26/8/2001	30.00	34.46	25.71	4.46	4.29			66.04		
2/9/2001	28.75	35.69	26.45	6.94	2.30			53.24		
9/9/2001	31.25	34.11	24.76	2.86	6.49			67.69		
16/9/2001	22.75	36.35	26.49	13.60	-3.74			30.59		
23/9/2001	19.50	33.61	13.83	14.11	5.67	-1950.00	100	24.64		
30/9/2001	17.75	34.88	5.68	17.13	12.07			21.98	-1775.00	1000
7/10/2001	18.25	25.78	14.33	7.53	3.92			24.66	-1825.00	1100
14/10/2001	18.00	24.06	14.37	6.06	3.63			24.18	-1800.00	1200
21/10/2001	18.00	23.51	14.90	5.51	3.10			24.18	-1800.00	1300
28/10/2001	18.50	23.42	14.83	4.92	3.67			27.91	-1850.00	1400
4/11/2001	17.50	23.98	15.41	6.48	2.09			25.06	-1750.00	1500
11/11/2001	16.80	23.07	14.35	6.27	2.45			23.16	-1680.00	1600
18/11/2001	16.90	21.57	12.54	4.67	4.36			24.11	-1690.00	1700
25/11/2001	21.60	24.48	15.70	2.88	5.90			54.60	-2160.00	1800
2/12/2001	19.70	27.91	16.65	8.21	3.05			45.99		
9/12/2001	19.80	28.37	13.69	8.57	6.11			46.50		
16/12/2001	19.10	26.15	16.41	7.05	2.69			43.19		
23/12/2001	19.00	25.07	16.41	6.07	2.59			42.68		
30/12/2001	19.50	24.32	15.53	4.82	3.97			46.28		
6/1/2002	20.20	25.14	16.57	4.94	3.63			51.23		
13/1/2002	20.30	24.82	16.17	4.52	4.13			51.95		
20/1/2002	20.50	26.23	17.49	5.73	3.01			53.56		

ตารางภาคผนวก ค 1 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
27/1/2002	28.25	27.45	18.77	-0.80	9.48			81.35		
3/2/2002	26.75	38.30	22.22	11.55	4.53	3830.00	0	71.76	48150.00	0
10/2/2002	31.75	42.49	18.27	10.74	13.48			80.57		
17/2/2002	31.50	40.74	28.52	9.24	2.98			79.15		
24/2/2002	29.25	41.83	26.96	12.58	2.29			66.87		
3/3/2002	31.75	36.88	27.54	5.13	4.21			72.36		
10/3/2002	32.25	39.24	28.41	6.99	3.84			73.38		
17/3/2002	31.00	39.94	29.79	8.94	1.21			66.33		
24/3/2002	30.00	38.33	29.53	8.33	0.47			60.92		
31/3/2002	30.25	36.83	27.65	6.58	2.60			61.82		
7/4/2002	30.75	37.79	28.80	7.04	1.95			63.74		
14/4/2002	30.00	38.05	29.47	8.05	0.53			58.63		
21/4/2002	32.25	37.45	28.75	5.20	3.50			67.62		
28/4/2002	34.75	39.83	30.41	5.08	4.34			74.67		
5/5/2002	34.75	42.71	31.81	7.96	2.94			74.67		
12/5/2002	34.75	42.97	32.48	8.22	2.27			74.67		
19/5/2002	32.25	40.62	32.06	8.37	0.19			55.95		
26/5/2002	34.50	41.37	32.13	6.87	2.37			65.05		
2/6/2002	38.00	43.02	32.98	5.02	5.02			74.50		
9/6/2002	39.25	45.92	35.92	6.67	3.33			77.06		
16/6/2002	45.25	48.13	36.99	2.88	8.26			85.25		
23/6/2002	39.75	54.75	40.95	15.00	-1.20			61.88		
30/6/2002	40.25	54.04	30.85	13.79	9.40	-4025.00	100	62.95		
7/7/2002	40.25	51.52	33.96	11.27	6.29			62.95		
14/7/2002	41.75	47.53	38.94	5.78	2.81			66.67		
21/7/2002	41.00	49.05	40.27	8.05	0.73			63.02		
28/7/2002	37.25	47.57	38.44	10.32	-1.19			47.89		

ตารางภาคผนวก ค 1 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
4/8/2002	38.00	45.33	34.52	7.33	3.48	-3800.00	200	50.62		
11/8/2002	37.25	47.36	34.43	10.11	2.82			47.73		
18/8/2002	39.00	44.63	35.38	5.63	3.62			54.70		
25/8/2002	39.00	46.74	37.45	7.74	1.55			54.70		
1/9/2002	37.00	46.71	37.34	9.71	-0.34			45.47		
8/9/2002	33.00	43.93	34.77	10.93	-1.77	-3300.00	300	32.74		
15/9/2002	33.50	41.59	29.59	8.09	3.91	-3350.00	400	35.35		
22/9/2002	30.25	42.10	28.97	11.85	1.28			27.38		
29/9/2002	27.25	38.21	28.05	10.96	-0.80			22.07	-2725.00	100
6/10/2002	26.25	35.10	22.13	8.85	4.12	-2625.00	500	20.54	-2625.00	200
13/10/2002	25.50	35.54	24.36	10.04	1.14			19.38	-2550.00	300
20/10/2002	25.50	32.74	24.04	7.24	1.46			19.38	-2550.00	400
27/10/2002	29.00	33.89	24.97	4.89	4.03			40.36	-2900.00	500
3/11/2002	31.50	38.68	28.40	7.18	3.10			50.89		
10/11/2002	31.25	40.89	28.45	9.64	2.80			49.87		
17/11/2002	32.00	39.30	29.50	7.30	2.50			53.11		
24/11/2002	33.25	40.36	31.74	7.11	1.51			58.30		
1/12/2002	35.75	41.86	33.02	6.11	2.73			66.77		
8/12/2002	36.50	43.87	34.31	7.37	2.19			68.96		
15/12/2002	36.50	45.38	35.27	8.88	1.23			68.96		
22/12/2002	33.50	45.02	36.33	11.52	-2.83			51.08		
29/12/2002	32.50	41.82	31.87	9.32	0.63	-3250.00	600	46.44		
5/1/2003	31.75	41.36	29.86	9.61	1.89			43.06		
12/1/2003	30.25	39.72	30.99	9.47	-0.74			36.87		
19/1/2003	31.00	38.65	29.70	7.65	1.30	-3100.00	700	41.71		
26/1/2003	32.50	39.36	30.05	6.86	2.45			50.46		
2/2/2003	31.25	41.23	32.40	9.98	-1.15			44.09		

ตารางภาคผนวก ค 1 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
9/2/2003	31.75	39.00	30.00	7.25	1.75	-3175.00	800	47.17		
16/2/2003	29.25	39.74	30.79	10.49	-1.54			35.80		
23/2/2003	30.50	36.42	26.83	5.92	3.67	-3050.00	900	43.64		
2/3/2003	29.50	41.18	30.42	11.68	-0.92			39.22		
9/3/2003	29.50	38.21	27.96	8.71	1.54	-2950.00	1000	39.22		
16/3/2003	29.25	37.87	28.31	8.62	0.94			37.94		
23/3/2003	31.00	37.02	28.46	6.02	2.54			50.88		
30/3/2003	30.75	39.64	30.56	8.89	0.19			49.19		
6/4/2003	28.00	39.92	30.31	11.92	-2.31			34.60		
13/4/2003	28.75	36.58	26.40	7.83	2.35	-2875.00	1100	40.18		
20/4/2003	28.50	38.78	26.91	10.28	1.59			38.90		
27/4/2003	26.25	36.12	27.38	9.87	-1.13			29.25		
4/5/2003	26.50	34.85	25.66	8.35	0.84	-2650.00	1200	31.43	-2650.00	600
11/5/2003	28.00	35.93	26.18	7.93	1.82			43.49		
18/5/2003	28.50	37.05	28.31	8.55	0.19			47.08		
25/5/2003	29.25	36.47	27.55	7.22	1.70			52.31		
1/6/2003	28.75	37.80	29.17	9.05	-0.42			48.61		
8/6/2003	33.00	37.93	29.07	4.93	3.93	-3300.00	1300	69.65		
15/6/2003	37.00	41.51	30.70	4.51	6.30			78.99		
22/6/2003	37.25	48.91	34.39	11.66	2.86			79.44	22350	0
29/6/2003	37.75	47.42	34.81	9.67	2.94			80.43		
6/7/2003	40.00	45.58	37.01	5.58	2.99			84.31		
13/7/2003	45.75	49.07	39.46	3.32	6.29			90.10		
20/7/2003	45.50	57.74	42.03	12.24	3.47			88.47		
27/7/2003	46.00	58.81	39.84	12.81	6.16			88.93		
3/8/2003	46.75	54.61	45.99	7.86	0.76			89.65		
10/8/2003	45.00	55.14	46.41	10.14	-1.41			76.27		

ตารางภาคผนวก ค 1 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
17/8/2003	45.25	53.48	44.43	8.23	0.82	-4525.00	1400	76.84		
24/8/2003	54.00	54.34	45.19	0.34	8.81			88.24		
31/8/2003	57.00	69.19	50.11	12.19	6.89			90.16		
7/9/2003	57.00	76.90	46.05	19.90	10.95			90.16		
14/9/2003	57.50	66.38	56.10	8.88	1.40			90.50		
21/9/2003	53.00	66.60	58.02	13.60	-5.02			66.42		
28/9/2003	53.50	63.25	51.48	9.75	2.02	-5350.00	1500	67.53		
5/10/2003	48.25	65.04	49.93	16.79	-1.68			48.25		
12/10/2003	53.00	59.62	47.34	6.62	5.66	-5300.00	1600	60.13		
19/10/2003	50.00	66.37	47.56	16.37	2.44			51.51		
26/10/2003	50.00	62.82	47.27	12.82	2.73			51.51		
2/11/2003	51.50	58.72	47.54	7.22	3.96			55.74		
9/11/2003	58.00	61.82	52.86	3.82	5.14			69.17		
16/11/2003	57.00	69.74	54.95	12.74	2.05			65.63		
23/11/2003	51.00	71.40	51.45	20.40	-0.45			48.48		
30/11/2003	49.75	61.83	47.69	12.08	2.06	-4975.00	1700	45.61		
7/12/2003	48.75	64.25	44.81	15.50	3.94			43.25		
14/12/2003	48.25	58.99	49.93	10.74	-1.68			42.00		
21/12/2003	47.50	56.84	47.79	9.34	-0.29	-4750.00	1800	39.99		
28/12/2003	45.00	56.72	47.83	11.72	-2.83	-4500.00	1900	33.79		
4/1/2004	45.75	54.60	44.97	8.85	0.78	-4575.00	2000	37.16		
11/1/2004	48.00	55.57	45.07	7.57	2.93			46.59		
18/1/2004	54.50	56.38	47.95	1.88	6.55			64.39		
25/1/2004	55.00	67.51	51.41	12.51	3.59			65.42		
1/2/2004	49.00	69.66	48.48	20.66	0.52			46.80		
8/2/2004	49.50	60.76	47.14	11.26	2.36			48.21		
15/2/2004	56.50	62.79	44.00	6.29	12.50			63.79		

ตารางภาคผนวก ก 1 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
22/2/2004	58.50	67.56	51.09	9.06	7.41			67.06		
29/2/2004	60.00	76.29	50.74	16.29	9.26			69.45		
7/3/2004	59.50	69.70	59.10	10.20	0.40			67.57		
14/3/2004	58.00	67.73	58.58	9.73	-0.58			61.77		
21/3/2004	57.50	65.53	56.70	8.03	0.80	-5750.00	2100	59.80		
28/3/2004	55.00	66.80	57.81	11.80	-2.81			50.49		
4/4/2004	59.00	64.12	54.61	5.12	4.39	-5900.00	2200	61.54		
11/4/2004	59.00	69.98	57.27	10.98	1.73			61.54		
18/4/2004	62.50	70.73	57.62	8.23	4.88			69.48		
25/4/2004	63.00	72.00	62.06	9.00	0.94			70.48		
2/5/2004	57.00	71.10	59.68	14.10	-2.68			48.43		
9/5/2004	53.00	67.79	55.99	14.79	-2.99	-5300.00	2300	39.03		
16/5/2004	51.00	66.43	49.51	15.43	1.49	-5100.00	2400	35.10		
23/5/2004	54.00	62.12	49.19	8.12	4.81			44.73		
30/5/2004	60.00	66.06	55.02	6.06	4.98			58.83		
6/6/2004	55.50	72.22	57.26	16.72	-1.76			48.19		
13/6/2004	53.00	71.33	52.05	18.33	0.95	-5300.00	2500	43.19		
20/6/2004	54.00	65.04	49.11	11.04	4.89			45.78		
27/6/2004	55.50	65.58	53.43	10.08	2.07			49.76		
4/7/2004	57.00	65.57	56.16	8.57	0.84			53.68		
11/7/2004	56.00	65.14	56.04	9.14	-0.04			50.64		
18/7/2004	55.00	64.60	55.37	9.60	-0.37	-5500.00	2600	47.54		
25/7/2004	54.00	64.55	55.80	10.55	-1.80	-5400.00	2700	44.39		
1/8/2004	52.50	65.10	56.34	12.60	-3.84	-5250.00	2800	39.84		
8/8/2004	50.00	62.24	52.44	12.24	-2.44	-5000.00	2900	33.27		
15/8/2004	50.00	49.96	49.82	-0.04	0.18	-5000.00	3000	33.27		
22/8/2004	48.25	61.33	50.62	13.08	-2.37	144750.00	0	28.84		

ตารางภาคผนวก ค 1 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
29/8/2004	52.50	57.68	48.62	5.18	3.88	-5250.00	100	48.18	-5250	100
5/9/2004	52.50	64.36	52.48	11.86	0.02			48.18		
12/9/2004	54.00	64.11	50.81	10.11	3.19			54.05		
19/9/2004	54.50	62.83	53.90	8.33	0.60			55.97		
26/9/2004	52.00	62.25	52.96	10.25	-0.96			45.10		
3/10/2004	50.00	61.69	52.62	11.69	-2.62	-5000.00	200	38.25		
10/10/2004	50.50	61.39	51.55	10.89	-1.05	-5050.00	300	40.84		
17/10/2004	48.75	60.50	50.80	11.75	-2.05	-4875.00	400	34.92		
24/10/2004	48.75	55.75	46.72	7.00	2.03	-4875.00	500	34.92		
31/10/2004	48.50	56.75	47.20	8.25	1.30			33.99		
7/11/2004	47.50	57.80	48.99	10.30	-1.49			30.24		
14/11/2004	49.00	56.88	48.24	7.88	0.76	-4900.00	600	41.41		
21/11/2004	49.00	58.35	49.34	9.35	-0.34			41.41		
28/11/2004	48.50	57.71	48.63	9.21	-0.13	-4850.00	700	38.67		
5/12/2004	48.50	58.75	50.13	10.25	-1.63	-4850.00	800	38.67		
12/12/2004	49.25	56.55	47.86	7.30	1.39	-4925.00	900	45.84		
19/12/2004	50.00	58.73	49.91	8.73	0.09			52.29		
26/12/2004	50.50	58.95	49.88	8.45	0.62			56.29		
						-26870.00	900		7295	0

ที่มา: จากการคำนวณ

ตารางภาคผนวก ค 2 สถานการณ์จำลองการซื้อขายหลักทรัพย์ TTA ด้วยการวิเคราะห์ทางเทคนิค

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
2/1/2000	0.74							29.24		
9/1/2000	0.67	0.69	0.15	0.02	0.52			22.35	-67.00	100
16/1/2000	0.59	0.65	0.17	0.06	0.42			17.06	-59.00	200
23/1/2000	0.69	0.86	0.30	0.17	0.39			38.18	-69.00	300
30/1/2000	0.68	0.84	0.52	0.16	0.16			37.09		
6/2/2000	0.67	0.75	0.59	0.08	0.08			35.91		
13/2/2000	0.61	0.66	0.64	0.05	-0.03			29.41		
20/2/2000	0.65	0.60	0.58	-0.05	0.07	-65.00	100	38.03	-65.00	400
27/2/2000	0.59	0.66	0.65	0.07	-0.06	59.00	0	31.40		
5/3/2000	0.53	0.59	0.56	0.06	-0.03	-59.00	100	26.14		
12/3/2000	0.58	0.53	0.51	-0.05	0.07	-58.00	200	36.39	-58.00	500
19/3/2000	0.60	0.57	0.55	-0.03	0.05	120.00	0	40.22		
26/3/2000	0.55	0.61	0.58	0.06	-0.03			34.27		
2/4/2000	0.56	0.54	0.52	-0.02	0.04	-56.00	100	36.44		
9/4/2000	0.57	0.55	0.54	-0.02	0.03	57.00	0	38.77		
16/4/2000	0.56	0.58	0.56	0.02	0.00			37.19		
23/4/2000	0.60	0.56	0.55	-0.04	0.05			47.11		
30/4/2000	0.59	0.59	0.58	0.00	0.01			45.06		
7/5/2000	0.60	0.59	0.58	-0.01	0.02			47.69		
14/5/2000	0.56	0.60	0.59	0.04	-0.03			39.06		
21/5/2000	0.57	0.55	0.54	-0.02	0.03	-57.00	100	42.08		
28/5/2000	0.52	0.57	0.56	0.05	-0.04	52.00	0	32.72		
4/6/2000	0.55	0.52	0.50	-0.03	0.05	-55.00	100	41.70		
11/6/2000	0.54	0.55	0.53	0.01	0.01	54.00	0	39.66		
18/6/2000	0.60	0.53	0.52	-0.07	0.08			54.91		
25/6/2000	0.64	0.60	0.58	-0.04	0.06			62.24		
2/7/2000	0.60	0.64	0.60	0.04	0.00			52.41		

ตารางภาคผนวก ค 2 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		Gain	stock
9/7/2000	0.61	0.60	0.59	-0.01	0.02			54.48		
16/7/2000	0.64	0.60	0.60	-0.04	0.04			60.45		
23/7/2000	0.62	0.65	0.63	0.03	-0.01			54.91		
30/7/2000	0.59	0.62	0.61	0.03	-0.02	-59.00	100	47.39		
6/8/2000	0.60	0.58	0.57	-0.02	0.03	-60.00	200	50.02		
13/8/2000	0.61	0.59	0.59	-0.02	0.02	122.00	0	52.75		
20/8/2000	0.59	0.61	0.60	0.02	-0.01			46.85		
27/8/2000	0.57	0.58	0.57	0.01	0.00	-57.00	100	41.50		
3/9/2000	0.58	0.56	0.55	-0.02	0.03			45.12		
10/9/2000	0.60	0.58	0.57	-0.02	0.03	60.00	0	51.97		
17/9/2000	0.61	0.60	0.59	-0.01	0.02			55.20		
24/9/2000	0.58	0.60	0.59	0.02	-0.01			44.78		
1/10/2000	0.59	0.57	0.56	-0.02	0.03	-59.00	100	48.52		
8/10/2000	0.56	0.59	0.58	0.03	-0.02	56.00	0	39.31		
15/10/2000	0.58	0.56	0.55	-0.02	0.03	-58.00	100	47.04		
22/10/2000	0.58	0.58	0.57	0.00	0.01	58.00	0	47.04		
29/10/2000	0.59	0.57	0.56	-0.02	0.03			51.18		
5/11/2000	0.60	0.59	0.58	-0.01	0.02			55.22		
12/11/2000	0.61	0.59	0.58	-0.02	0.03			59.12		
19/11/2000	0.60	0.61	0.60	0.01	0.00			53.72		
26/11/2000	0.60	0.59	0.59	-0.01	0.01			53.72		
3/12/2000	0.60	0.59	0.59	-0.01	0.01			53.72		
10/12/2000	0.60	0.59	0.59	-0.01	0.01			53.72		
17/12/2000	0.59	0.60	0.59	0.01	0.00			46.23		
24/12/2000	0.60	0.58	0.58	-0.02	0.02			53.68		
31/12/2000	0.59	0.59	0.59	0.00	0.00			46.28		
7/1/2001	0.59	0.58	0.58	-0.01	0.01			46.28		

ตารางภาคผนวก ค 2 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		Gain	stock
14/1/2001	0.57	0.58	0.58	0.01	-0.01			33.86		
21/1/2001	0.57	0.56	0.56	-0.01	0.01	-57.00	100	33.86		
28/1/2001	0.57	0.56	0.56	-0.01	0.01	57.00	0	33.86		
4/2/2001	0.57	0.56	0.56	-0.01	0.01			33.86		
11/2/2001	0.58	0.56	0.56	-0.02	0.02			46.57		
18/2/2001	0.56	0.57	0.56	0.01	0.00			32.26		
25/2/2001	0.54	0.55	0.55	0.01	-0.01			23.82		
4/3/2001	0.54	0.53	0.53	-0.01	0.01	-54.00	100	23.82	-54.00	600
11/3/2001	0.53	0.53	0.53	0.00	0.00			20.28	-53.00	700
18/3/2001	0.49	0.52	0.52	0.03	-0.03			12.04	-49.00	800
25/3/2001	0.44	0.48	0.48	0.04	-0.04	-44.00	200	7.59	-44.00	900
1/4/2001	0.45	0.43	0.42	-0.02	0.03	-45.00	300	14.85	-45.00	1000
8/4/2001	0.43	0.45	0.44	0.02	-0.01	129.00	0	12.57	-43.00	1100
15/4/2001	0.44	0.42	0.41	-0.02	0.03	-44.00	100	19.68	-44.00	1200
22/4/2001	0.45	0.43	0.42	-0.02	0.03	45.00	0	26.58	-45.00	1300
29/4/2001	0.44	0.44	0.43	0.00	0.01			24.18	-44.00	1400
6/5/2001	0.47	0.44	0.43	-0.03	0.04			42.21	-47.00	1500
13/5/2001	0.47	0.46	0.45	-0.01	0.02			42.21		
20/5/2001	0.61	0.47	0.46	-0.14	0.15			76.67		
27/5/2001	0.88	0.63	0.57	-0.25	0.31			89.97	1320.00	0
3/6/2001	0.99	1.02	0.72	0.03	0.27			92.09		
10/6/2001	0.95	1.20	0.77	0.25	0.18			84.59		
17/6/2001	0.95	1.01	0.87	0.06	0.08			84.59		
24/6/2001	1.10	0.97	0.95	-0.13	0.15			89.05		
1/7/2001	1.40	1.16	1.10	-0.24	0.30			93.43		
8/7/2001	1.28	1.55	1.26	0.27	0.01			78.35		
15/7/2001	1.18	1.43	1.09	0.26	0.09			68.20		

ตารางภาคผนวก ค 2 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
22/7/2001	1.18	1.18	1.15	0.00	0.02			68.20		
29/7/2001	1.30	1.19	1.18	-0.11	0.12			73.84		
5/8/2001	1.23	1.35	1.31	0.12	-0.08			65.76		
12/8/2001	1.50	1.23	1.16	-0.27	0.34	-150.00	100	76.60		
19/8/2001	1.60	1.61	1.34	0.01	0.26	160.00	0	79.34		
26/8/2001	1.70	1.84	1.34	0.14	0.36			81.80		
2/9/2001	1.65	1.81	1.60	0.16	0.05			76.54		
9/9/2001	1.60	1.69	1.55	0.09	0.05			71.25		
16/9/2001	1.28	1.64	1.63	0.36	-0.36			46.94		
23/9/2001	1.28	1.42	1.15	0.14	0.13	-128.00	100	46.94		
30/9/2001	1.30	1.51	1.05	0.21	0.25			48.73		
7/10/2001	1.28	1.30	1.26	0.02	0.01			46.90		
14/10/2001	1.30	1.28	1.24	-0.02	0.06			49.10		
21/10/2001	1.30	1.24	1.23	-0.06	0.07	130.00	0	49.10		
28/10/2001	1.33	1.30	1.27	-0.02	0.05			51.77		
4/11/2001	1.30	1.33	1.30	0.03	0.00			48.82		
11/11/2001	1.35	1.30	1.28	-0.05	0.07			54.76		
18/11/2001	1.36	1.35	1.34	-0.01	0.02			55.94		
25/11/2001	1.39	1.37	1.34	-0.02	0.05			59.60		
2/12/2001	1.44	1.39	1.38	-0.05	0.06			65.15		
9/12/2001	1.32	1.44	1.41	0.12	-0.09			47.19		
16/12/2001	1.40	1.34	1.30	-0.06	0.10	-140.00	100	56.43		
23/12/2001	1.40	1.42	1.36	0.02	0.04	140.00	0	56.43		
30/12/2001	1.43	1.42	1.37	-0.01	0.06			59.93		
6/1/2002	1.40	1.44	1.42	0.04	-0.02			54.84		
13/1/2002	1.40	1.38	1.36	-0.02	0.04	-140.00	100	54.84		
20/1/2002	1.44	1.41	1.40	-0.03	0.04	144.00	100	60.75		

ตารางภาคผนวก ค 2 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
27/1/2002	1.51	1.44	1.42	-0.07	0.09			68.96		
3/2/2002	1.52	1.52	1.49	0.00	0.03			69.99		
10/2/2002	1.79	1.52	1.49	-0.27	0.30			85.27		
17/2/2002	2.33	1.89	1.68	-0.44	0.65			93.23		
24/2/2002	2.07	2.89	1.76	0.82	0.31			71.71		
3/3/2002	2.20	2.76	1.38	0.56	0.82			75.03		
10/3/2002	2.19	2.30	2.08	0.11	0.11			74.26		
17/3/2002	2.02	2.36	2.09	0.34	-0.07			61.75		
24/3/2002	2.27	2.12	2.06	-0.15	0.21	-227.00	100	70.25		
31/3/2002	2.38	2.31	2.14	-0.07	0.24	238.00	0	73.27		
7/4/2002	2.50	2.52	2.26	0.02	0.24			76.29		
14/4/2002	3.00	2.60	2.38	-0.40	0.62			84.65		
21/4/2002	2.90	3.36	2.56	0.46	0.34			78.28		
28/4/2002	2.93	3.51	2.32	0.59	0.61			78.74		
5/5/2002	3.10	2.96	2.91	-0.14	0.19			81.86		
12/5/2002	3.35	3.18	3.03	-0.17	0.32			85.38		
19/5/2002	3.25	3.57	3.26	0.32	-0.01			78.35		
26/5/2002	3.30	3.40	3.06	0.10	0.24	-330.00	100	79.33		
2/6/2002	3.50	3.33	3.25	-0.17	0.25	350.00	0	82.91		
9/6/2002	3.60	3.61	3.41	0.01	0.19			84.46		
16/6/2002	3.78	3.76	3.49	-0.02	0.28			86.87		
23/6/2002	3.60	3.82	3.65	0.22	-0.05			73.70		
30/6/2002	3.60	3.69	3.51	0.09	0.09	-360.00	100	73.70		
7/7/2002	3.58	3.64	3.60	0.07	-0.02			71.63		
14/7/2002	3.63	3.58	3.57	-0.04	0.06	-363.00	200	73.35		
21/7/2002	3.55	3.64	3.63	0.09	-0.08	710.00	0	66.37		
28/7/2002	3.38	3.53	3.50	0.16	-0.13	-338.00	100	52.84		

ตารางภาคผนวก ค 2 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
4/8/2002	3.60	3.39	3.34	-0.21	0.26	-360.00	200	63.79		
11/8/2002	3.43	3.69	3.48	0.26	-0.05	686.00	0	52.79		
18/8/2002	3.55	3.56	3.28	0.01	0.27	-355.00	100	58.66		
25/8/2002	3.53	3.59	3.46	0.06	0.06			57.03		
1/9/2002	3.55	3.56	3.42	0.01	0.13			58.37		
8/9/2002	3.33	3.59	3.56	0.26	-0.23			44.08		
15/9/2002	3.30	3.37	3.21	0.07	0.09	-330.00	200	42.74		
22/9/2002	3.40	3.41	3.21	0.01	0.19			49.79		
29/9/2002	3.38	3.42	3.36	0.04	0.02			48.08		
6/10/2002	3.55	3.41	3.33	-0.14	0.22			59.35		
13/10/2002	3.58	3.55	3.45	-0.02	0.12	720.00	0	60.75		
20/10/2002	3.45	3.66	3.47	0.21	-0.02			50.66		
27/10/2002	3.53	3.48	3.42	-0.04	0.10	-350.00	100	55.75		
3/11/2002	3.66	3.53	3.49	-0.13	0.17	370.00	0	63.55		
10/11/2002	3.62	3.73	3.62	0.11	0.00			59.94		
17/11/2002	3.66	3.68	3.56	0.02	0.10			62.41		
24/11/2002	3.72	3.64	3.62	-0.08	0.10			66.03		
1/12/2002	3.78	3.74	3.69	-0.04	0.09			69.43		
8/12/2002	3.94	3.82	3.76	-0.12	0.18			76.62		
15/12/2002	3.84	3.97	3.87	0.13	-0.03			65.50		
22/12/2002	3.84	3.90	3.77	0.06	0.07	-384.00	100	65.50		
29/12/2002	3.90	3.85	3.83	-0.05	0.07			69.09		
5/1/2003	3.84	3.91	3.89	0.07	-0.05	384.00	0	61.69		
12/1/2003	3.44	3.86	3.84	0.42	-0.40	-344.00	100	33.84		
19/1/2003	3.58	3.59	3.25	0.01	0.33	-358.00	200	44.04		
26/1/2003	3.62	3.91	3.22	0.29	0.40			46.75		
2/2/2003	3.66	3.74	3.49	0.08	0.17			49.56		

ตารางภาคผนวก ค 2 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
9/2/2003	3.40	3.69	3.59	0.29	-0.19			35.49		
16/2/2003	3.36	3.39	3.26	0.03	0.10	-336.00	300	33.79		
23/2/2003	3.38	3.46	3.29	0.08	0.09			35.57		
2/3/2003	3.60	3.39	3.36	-0.21	0.24			51.99		
9/3/2003	3.50	3.67	3.52	0.17	-0.02	1050.00	0	45.86		
16/3/2003	3.38	3.57	3.34	0.19	0.04	-338.00	100	39.42		
23/3/2003	3.70	3.38	3.37	-0.32	0.33			57.69		
30/3/2003	3.68	3.82	3.56	0.14	0.12	368.00	0	56.46		
6/4/2003	3.72	3.92	3.48	0.20	0.24			58.50		
13/4/2003	4.00	3.71	3.68	-0.29	0.32			69.89		
20/4/2003	4.12	4.11	3.84	-0.01	0.28			73.49		
27/4/2003	4.14	4.40	3.91	0.26	0.23			74.08		
4/5/2003	4.50	4.21	4.05	-0.29	0.45			82.33		
11/5/2003	5.35	4.69	4.29	-0.66	1.06			90.53		
18/5/2003	5.60	6.65	4.12	1.05	1.48			91.82		
25/5/2003	6.60	7.39	3.83	0.79	2.77			94.98		
1/6/2003	6.50	8.47	4.71	1.97	1.79			90.93		
8/6/2003	6.40	9.27	3.81	2.87	2.59			86.67		
15/6/2003	7.05	6.57	6.46	-0.48	0.59			90.13		
22/6/2003	7.50	7.46	6.69	-0.04	0.81			91.83		
29/6/2003	7.30	8.55	6.72	1.25	0.58			84.39		
6/7/2003	8.30	7.84	6.72	-0.46	1.58			89.36		
13/7/2003	9.00	9.75	6.78	0.75	2.22			91.54		
20/7/2003	9.80	12.45	5.69	2.65	4.11			93.34		
27/7/2003	10.00	12.62	7.09	2.62	2.91			93.72		
3/8/2003	10.10	12.11	7.77	2.01	2.33			93.93		
10/8/2003	10.90	10.74	9.74	-0.16	1.16			95.32		

ตารางภาคผนวก ค 2 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
17/8/2003	12.30	11.95	10.05	-0.35	2.25			96.80		
24/8/2003	13.60	15.83	8.96	2.23	4.64			97.61		
31/8/2003	15.00	20.03	7.19	5.03	7.81			98.18		
7/9/2003	14.70	22.74	7.29	8.04	7.41			92.70		
14/9/2003	15.00	20.84	8.74	5.84	6.26			93.14		
21/9/2003	15.30	15.63	14.73	0.33	0.57			93.59		
28/9/2003	18.60	16.22	14.71	-2.38	3.89			96.49		
5/10/2003	17.60	30.53	7.06	12.93	10.54			83.29		
12/10/2003	22.80	37.90	-2.81	15.10	25.61			90.82		
19/10/2003	26.00	62.52	-16.88	36.52	42.88			93.05		
26/10/2003	25.00	111.85	-59.83	86.85	84.83			85.57		
2/11/2003	30.25	58.56	-7.66	28.31	37.91			90.29		
9/11/2003	34.00	66.21	-6.08	32.21	40.08			92.36		
16/11/2003	32.50	122.05	-52.51	89.55	85.01			84.11		
23/11/2003	31.00	78.44	-12.52	47.44	43.52			76.25		
30/11/2003	33.50	32.68	29.00	-0.82	4.50			79.87		
7/12/2003	39.00	44.58	23.82	5.58	15.18			85.48		
14/12/2003	39.50	85.75	-6.61	46.25	46.11			85.89		
21/12/2003	38.50	92.99	-14.68	54.49	53.18			80.61		
28/12/2003	37.00	40.51	35.89	3.51	1.11			72.85		
4/1/2004	39.00	38.91	35.85	-0.09	3.15			76.35		
11/1/2004	45.25	44.97	34.43	-0.28	10.82			83.86		
18/1/2004	47.75	89.46	1.00	41.71	46.75			85.92		
25/1/2004	47.75	126.91	-31.63	79.16	79.38			85.92		
1/2/2004	42.00	74.31	20.81	32.31	21.19			61.75		
8/2/2004	44.50	70.90	13.56	26.40	30.94			66.48		
15/2/2004	46.25	97.38	-6.76	51.13	53.01			69.53		

ตารางภาคผนวก ค 2 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1 Std.	- 1 Std.	sell signal	buy signal	capital gain	sum stock	RSI	capital gain	sum stock
22/2/2004	45.00	69.81	23.41	24.81	21.59			64.69		
29/2/2004	44.00	54.06	35.95	10.06	8.05			60.78		
7/3/2004	41.25	44.73	41.61	3.48	-0.36			51.00		
14/3/2004	39.00	45.25	37.90	6.25	1.10	-3900.00	100	44.28		
21/3/2004	36.50	50.13	28.12	13.63	8.38			37.88		
28/3/2004	38.00	50.49	22.02	12.49	15.98			43.53		
4/4/2004	39.00	52.00	23.68	13.00	15.32			47.23		
11/4/2004	39.25	52.49	24.92	13.24	14.33			48.20		
18/4/2004	39.00	46.12	31.59	7.12	7.41			47.19		
25/4/2004	35.50	41.42	35.78	5.92	-0.28			35.27		
2/5/2004	32.00	45.05	26.45	13.05	5.55	-3200.00	200	27.31		
9/5/2004	30.50	58.47	5.85	27.97	24.65			24.57	-3050.00	100
16/5/2004	27.50	50.93	10.21	23.43	17.29			19.95	-2750.00	200
23/5/2004	30.00	34.69	20.33	4.69	9.67			32.21	-3000.00	300
30/5/2004	32.00	48.94	10.12	16.94	21.88			40.61		
6/6/2004	30.00	58.35	4.52	28.35	25.48			35.53		
13/6/2004	27.50	48.98	10.51	21.48	16.99			30.10		
20/6/2004	27.00	30.22	23.85	3.22	3.15			29.08		
27/6/2004	29.75	31.77	22.94	2.02	6.81			41.68		
4/7/2004	32.75	38.34	21.87	5.59	10.88			52.34		
11/7/2004	36.50	56.93	8.12	20.43	28.38			62.29		
18/7/2004	32.75	78.91	-6.60	46.16	39.35			50.20		
25/7/2004	32.25	81.06	-15.60	48.81	47.85			48.75		
1/8/2004	31.00	43.24	21.95	12.24	9.05			44.98		
8/8/2004	30.50	33.38	29.38	2.88	1.12			43.44		
15/8/2004	29.50	33.63	28.52	4.13	0.98			40.24		
22/8/2004	30.25	31.65	26.32	1.40	3.93			43.82		

ตารางภาคผนวก ค 2 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
29/8/2004	33.00	35.93	24.41	2.93	8.59			55.17		
5/9/2004	33.50	48.38	17.13	14.88	16.37			56.99		
12/9/2004	34.50	54.75	11.97	20.25	22.53			60.68		
19/9/2004	40.50	41.74	26.77	1.24	13.73			75.33		
26/9/2004	40.50	95.88	-14.53	55.38	55.03			75.33	12150.00	0
3/10/2004	41.50	125.15	-43.33	83.65	84.83			77.21		
10/10/2004	46.25	48.31	34.89	2.06	11.36			83.93		
17/10/2004	39.25	82.41	10.41	43.16	28.84			55.89		
24/10/2004	37.25	129.37	-49.05	92.12	86.30			50.35		
31/10/2004	34.25	110.19	-35.76	75.94	70.01			42.97		
7/11/2004	34.50	40.52	28.14	6.02	6.36			43.76		
14/11/2004	37.25	40.13	30.22	2.88	7.03			52.19		
21/11/2004	37.00	43.24	29.12	6.24	7.88			51.39		
28/11/2004	36.25	49.28	23.84	13.03	12.41			48.77		
5/12/2004	39.00	38.79	32.81	-0.21	6.19			57.84		
12/12/2004	36.25	52.30	25.73	16.05	10.52	7250.00	0	48.03		
19/12/2004	35.50	64.15	8.94	28.65	26.56			45.60		
26/12/2004	35.75	44.40	26.82	8.65	8.93			46.64		
						251.00	0		3884.00	0

ที่มา: จากการคำนวณ

ตารางภาคผนวก ค 3 สถานการณ์จำลองการซื้อขายหลักทรัพย์ PSL ด้วยการวิเคราะห์ทางเทคนิค

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
2/1/2000	1.00							42.34		
9/1/2000	1.00	1.62	0.62	0.62	0.38			42.34		
23/1/2000	1.20	1.60	0.60	0.40	0.60			58.31		
30/1/2000	1.18	1.79	0.61	0.61	0.56			56.07		
6/2/2000	1.20	1.39	0.96	0.19	0.24			57.94		
13/2/2000	1.15	1.21	1.19	0.06	-0.04			52.77		
20/2/2000	1.25	1.16	1.14	-0.09	0.11	-125.00	100	60.83		
27/2/2000	1.15	1.29	1.21	0.14	-0.06	115.00	0	50.82		
5/3/2000	1.10	1.19	1.11	0.09	-0.01	-110.00	100	46.41		
12/3/2000	1.00	1.12	1.08	0.12	-0.08	-100.00	200	38.67		
19/3/2000	1.03	1.03	0.97	0.01	0.06	-103.00	300	41.49		
26/3/2000	1.00	1.04	1.01	0.04	-0.01			39.40		
2/4/2000	1.03	1.01	0.99	-0.02	0.03	-103.00	400	42.72		
9/4/2000	1.00	1.03	1.02	0.03	-0.02	400.00	0	40.18		
16/4/2000	1.13	1.01	0.99	-0.12	0.13	-113.00	100	55.47		
23/4/2000	1.00	1.18	1.07	0.18	-0.07			42.84		
30/4/2000	1.05	1.07	0.93	0.02	0.12	-105.00	200	48.27		
7/5/2000	1.05	1.08	1.02	0.03	0.03			48.27		
14/5/2000	1.15	1.06	1.04	-0.09	0.11			58.73		
21/5/2000	1.03	1.19	1.11	0.16	-0.09	206.00	0	45.47		
28/5/2000	1.00	1.09	0.96	0.09	0.04	-100.00	100	43.22		
4/6/2000	0.97	1.06	1.02	0.09	-0.05			40.45		
11/6/2000	1.00	0.98	0.95	-0.02	0.05	-100.00	200	44.55		
18/6/2000	1.00	1.02	0.99	0.02	0.01	200.00	0	44.55		
25/6/2000	1.03	1.00	0.98	-0.03	0.04			48.49		
2/7/2000	1.00	1.05	1.04	0.05	-0.04			44.82		
9/7/2000	1.03	0.99	0.97	-0.03	0.06	-103.00	100	49.25		

ตารางภาคผนวก ค 3 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
16/7/2000	1.08	1.03	1.00	-0.05	0.07	108.00	0	57.19		
23/7/2000	1.28	1.08	1.03	-0.20	0.24			75.14		
30/7/2000	1.10	1.47	1.09	0.37	0.01			52.79		
6/8/2000	1.00	1.27	0.92	0.27	0.08			44.14		
13/8/2000	1.03	1.06	0.95	0.04	0.08			46.66		
20/8/2000	1.28	1.04	1.00	-0.24	0.27			64.93		
27/8/2000	1.30	1.55	1.05	0.25	0.25			66.27		
3/9/2000	1.50	1.40	1.15	-0.10	0.35			75.03		
10/9/2000	1.40	1.73	1.29	0.33	0.11			65.25		
17/9/2000	1.20	1.53	1.27	0.33	-0.07			50.16		
24/9/2000	1.05	1.34	1.10	0.29	-0.05	-105.00	100	41.80		
1/10/2000	1.10	1.16	0.89	0.06	0.21	-110.00	200	45.30		
8/10/2000	0.98	1.17	1.02	0.19	-0.04			38.83		
15/10/2000	1.18	1.02	0.91	-0.16	0.26	-118.00	300	51.76		
22/10/2000	1.18	1.38	0.99	0.20	0.19	354.00	0	51.76		
29/10/2000	1.05	1.26	1.09	0.21	-0.04			43.85		
5/11/2000	1.00	1.10	1.01	0.10	-0.01	-100.00	100	40.96		
12/11/2000	0.99	1.02	0.96	0.03	0.03	-99.00	200	40.34		
19/11/2000	1.00	1.01	0.99	0.01	0.01			41.36		
26/11/2000	0.98	1.02	1.01	0.04	-0.03			39.80		
3/12/2000	1.03	1.03	1.02	0.00	0.01	-103.00	300	45.17		
10/12/2000	0.98	0.99	0.98	0.01	0.00			40.95		
17/12/2000	1.05	0.96	0.96	-0.09	0.09			49.43		
24/12/2000	1.08	1.09	1.02	0.01	0.05	324.00	0	52.25		
31/12/2000	1.08	1.15	1.11	0.07	-0.03			52.25		
7/1/2001	1.08	1.09	1.06	0.01	0.01	-108.00	100	52.25		
14/1/2001	1.08	1.13	1.11	0.05	-0.04			52.25		

ตารางภาคผนวก ค 3 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
21/1/2001	1.08	1.06	1.04	-0.01	0.03	-108.00	200	52.25		
28/1/2001	1.08	1.04	1.03	-0.03	0.05	216.00	0	52.25		
4/2/2001	1.10	1.05	1.03	-0.05	0.07			57.81		
11/2/2001	1.10	1.14	1.09	0.04	0.01			57.81		
18/2/2001	1.10	1.09	1.07	-0.01	0.03			57.81		
25/2/2001	1.18	1.15	1.14	-0.03	0.04			72.54		
4/3/2001	1.03	1.18	1.16	0.16	-0.14			40.17		
11/3/2001	1.03	1.08	0.92	0.05	0.10	-103.00	100	40.17		
18/3/2001	1.05	1.06	0.97	0.01	0.08			45.56		
25/3/2001	1.10	1.06	1.04	-0.04	0.06			54.93		
1/4/2001	1.08	1.12	1.08	0.04	-0.01	108.00	0	49.97		
8/4/2001	1.08	1.08	1.06	0.00	0.02	-108.00	100	49.97		
15/4/2001	1.08	1.08	1.07	0.00	0.00			49.97		
22/4/2001	1.08	1.08	1.07	0.00	0.00			49.97		
29/4/2001	1.10	1.10	1.09	0.00	0.01			56.87		
6/5/2001	1.10	1.11	1.10	0.01	0.00			56.87		
13/5/2001	1.10	1.09	1.09	-0.01	0.01			56.87		
20/5/2001	1.13	1.10	1.10	-0.02	0.03	113.00	0	64.42		
27/5/2001	1.23	1.12	1.11	-0.10	0.12			80.31		
3/6/2001	1.33	1.28	1.18	-0.05	0.15			87.01		
10/6/2001	1.25	1.40	1.27	0.15	-0.02			67.22		
17/6/2001	1.28	1.30	1.22	0.03	0.05	-128.00	100	69.86		
24/6/2001	1.28	1.28	1.26	0.01	0.02			69.86		
1/7/2001	1.28	1.28	1.28	0.01	0.00			69.86		
8/7/2001	1.50	1.28	1.28	-0.22	0.22			85.73		
15/7/2001	1.50	1.65	1.29	0.15	0.21	150.00	0	85.73		
22/7/2001	1.48	1.60	1.41	0.13	0.07			79.53		

ตารางภาคผนวก ค 3 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
29/7/2001	1.50	1.49	1.47	-0.01	0.03			81.11		
5/8/2001	1.45	1.52	1.51	0.07	-0.06			68.88		
12/8/2001	1.85	1.46	1.43	-0.39	0.42	-185.00	100	86.99		
19/8/2001	1.75	2.46	1.24	0.71	0.51	175.00	0	74.49		
26/8/2001	1.90	2.05	1.45	0.15	0.45			79.57		
2/9/2001	1.80	2.03	1.77	0.23	0.03			68.99		
9/9/2001	1.80	1.88	1.72	0.08	0.08			68.99		
16/9/2001	1.60	1.81	1.79	0.21	-0.19			50.96		
23/9/2001	1.38	1.73	1.47	0.36	-0.09	-138.00	100	38.05		
30/9/2001	1.38	1.59	1.17	0.21	0.20	-138.00	200	38.05		
7/10/2001	1.40	1.47	1.32	0.07	0.08			40.29		
14/10/2001	1.40	1.42	1.41	0.02	-0.01			40.29		
21/10/2001	1.40	1.39	1.38	-0.01	0.02	-140.00	300	40.29		
28/10/2001	1.40	1.41	1.40	0.01	0.00	420.00	0	40.29		
4/11/2001	1.35	1.40	1.40	0.05	-0.05			35.72		
11/11/2001	1.40	1.36	1.34	-0.04	0.06	-140.00	100	43.16		
18/11/2001	1.40	1.46	1.43	0.06	-0.03	140.00	0	43.16		
25/11/2001	1.46	1.42	1.39	-0.04	0.07	-146.00	100	52.04		
2/12/2001	1.80	1.47	1.44	-0.33	0.36	180.00	0	76.27		
9/12/2001	1.55	2.25	1.35	0.70	0.20			53.39		
16/12/2001	1.37	1.91	1.17	0.54	0.20			42.73		
23/12/2001	1.36	1.59	1.32	0.23	0.04			42.19		
30/12/2001	1.43	1.39	1.29	-0.04	0.14			47.54		
6/1/2002	1.38	1.51	1.41	0.13	-0.03			44.18		
13/1/2002	1.39	1.40	1.32	0.01	0.07	-139.00	100	45.07		
20/1/2002	1.41	1.41	1.37	0.00	0.04			47.04		
27/1/2002	1.42	1.38	1.36	-0.04	0.06			48.11		

ตารางภาคผนวก ค 3 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1 Std.	- 1 Std.	sell signal	buy signal	capital gain	sum stock	RSI	capital gain	sum stock
3/2/2002	1.35	1.39	1.36	0.04	-0.01	135.00	0	41.35		
10/2/2002	1.48	1.36	1.34	-0.12	0.14	-148.00	100	54.92		
17/2/2002	1.73	1.55	1.41	-0.18	0.32	173.00	0	70.22		
24/2/2002	1.71	2.01	1.44	0.30	0.27			68.08		
3/3/2002	1.81	1.84	1.59	0.03	0.22			72.84		
10/3/2002	1.79	1.86	1.76	0.07	0.03			70.42		
17/3/2002	1.72	1.81	1.75	0.09	-0.03			62.08		
24/3/2002	1.74	1.74	1.72	0.00	0.02	-174.00	100	63.51		
31/3/2002	1.70	1.74	1.72	0.04	-0.02			58.44		
7/4/2002	1.89	1.72	1.71	-0.17	0.18	-189.00	200	71.08		
14/4/2002	1.92	2.08	1.84	0.16	0.08	384.00	0	72.60		
21/4/2002	1.90	1.93	1.81	0.03	0.09			69.78		
28/4/2002	2.03	1.88	1.86	-0.15	0.17			76.60		
5/5/2002	2.05	2.12	1.90	0.07	0.15			77.50		
12/5/2002	2.09	2.13	2.00	0.04	0.09			79.33		
19/5/2002	2.11	2.09	2.06	-0.02	0.05			80.26		
26/5/2002	2.23	2.13	2.10	-0.10	0.13			84.95		
2/6/2002	2.24	2.29	2.18	0.05	0.06			85.28		
9/6/2002	2.31	2.28	2.22	-0.03	0.09			87.53		
16/6/2002	2.33	2.33	2.28	0.00	0.05			88.13		
23/6/2002	2.27	2.37	2.34	0.10	-0.07			75.59		
30/6/2002	2.25	2.35	2.29	0.10	-0.04	-225.00	100	71.67		
7/7/2002	2.00	2.27	2.22	0.27	-0.22	-200.00	200	40.99		
14/7/2002	1.81	2.22	1.81	0.41	0.00	-181.00	300	29.80		
21/7/2002	1.83	2.02	1.60	0.19	0.23			32.05	-183.00	100
28/7/2002	1.62	1.88	1.75	0.26	-0.13			23.08		
4/8/2002	1.70	1.75	1.50	0.05	0.20	-170.00	400	31.51	-170.00	200

ตารางภาคผนวก ค 3 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
11/8/2002	1.72	1.79	1.60	0.07	0.12			33.61		
18/8/2002	1.80	1.78	1.73	-0.02	0.07			41.83		
25/8/2002	1.75	1.81	1.78	0.06	-0.03	700.00	0	38.40		
1/9/2002	1.70	1.77	1.74	0.07	-0.04	-170.00	100	35.08		
8/9/2002	1.97	1.75	1.72	-0.22	0.25	-197.00	200	57.81		
15/9/2002	1.82	2.19	1.76	0.37	0.06	364.00	0	47.21		
22/9/2002	1.66	1.98	1.66	0.32	0.00			38.52		
29/9/2002	1.71	1.76	1.57	0.05	0.14			42.35		
6/10/2002	1.73	1.78	1.68	0.05	0.05			43.96		
13/10/2002	1.78	1.74	1.72	-0.04	0.06			48.14		
20/10/2002	1.82	1.81	1.78	-0.01	0.04			51.48		
27/10/2002	1.80	1.84	1.81	0.04	-0.01			49.63		
3/11/2002	1.78	1.79	1.78	0.01	0.00	-178.00	100	47.66		
10/11/2002	1.85	1.77	1.76	-0.08	0.09			54.89		
17/11/2002	1.75	1.83	1.77	0.08	-0.02	175.00	0	44.71		
24/11/2002	1.71	1.73	1.69	0.02	0.02	-171.00	100	41.19		
1/12/2002	1.75	1.72	1.71	-0.03	0.04			46.09		
8/12/2002	1.78	1.72	1.70	-0.06	0.08	178.00	0	49.72		
15/12/2002	2.20	1.82	1.77	-0.38	0.43			75.91		
22/12/2002	2.00	2.82	1.59	0.82	0.41			59.02	400.00	0
29/12/2002	2.00	2.38	1.64	0.38	0.36			59.02		
5/1/2003	1.98	2.04	1.95	0.06	0.03			57.32		
12/1/2003	1.90	1.97	1.96	0.07	-0.06			50.60		
19/1/2003	1.98	1.97	1.93	-0.01	0.05	-198.00	100	56.49		
26/1/2003	2.25	1.96	1.93	-0.29	0.32			70.28		
2/2/2003	2.19	2.56	1.87	0.37	0.32	219.00	0	65.00		
9/2/2003	2.31	2.36	2.04	0.05	0.27			70.17		

ตารางภาคผนวก ค 3 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1 Std.	- 1 Std.	sell signal	buy signal	capital gain	sum stock	RSI	capital gain	sum stock
16/2/2003	2.38	2.38	2.24	0.00	0.14			72.87		
23/2/2003	2.58	2.45	2.33	-0.12	0.25			78.98		
2/3/2003	2.60	2.74	2.42	0.14	0.18			79.66		
9/3/2003	2.20	2.67	2.52	0.47	-0.32			49.93		
16/3/2003	2.40	2.71	1.69	0.31	0.71	-240.00	100	58.80		
23/3/2003	2.40	2.87	1.96	0.47	0.44			58.80		
30/3/2003	2.45	2.50	2.28	0.05	0.17			61.09		
6/4/2003	2.75	2.48	2.42	-0.27	0.33			71.92		
13/4/2003	2.78	3.11	2.41	0.33	0.37	278.00	0	72.65		
20/4/2003	3.10	2.96	2.61	-0.14	0.49			80.34		
27/4/2003	3.28	3.59	2.77	0.32	0.50			83.26		
4/5/2003	3.25	3.49	2.98	0.24	0.27			81.27		
11/5/2003	3.48	3.29	3.21	-0.19	0.27			85.00		
18/5/2003	3.48	3.68	3.26	0.21	0.21			85.00		
25/5/2003	4.08	3.56	3.36	-0.51	0.72			91.21		
1/6/2003	4.08	5.50	2.66	1.43	1.41			91.21		
8/6/2003	4.38	4.83	3.44	0.45	0.93			93.11		
15/6/2003	4.35	4.68	4.06	0.33	0.29			91.21		
22/6/2003	4.68	4.52	4.23	-0.16	0.45			93.27		
29/6/2003	4.65	5.07	4.31	0.42	0.34			91.37		
6/7/2003	6.25	4.87	4.51	-1.38	1.74			96.55		
13/7/2003	6.25	15.14	-2.63	8.89	8.88			96.55		
20/7/2003	7.15	10.51	1.83	3.36	5.32			97.62		
27/7/2003	6.90	11.61	2.77	4.71	4.13			88.79		
3/8/2003	7.00	9.05	4.74	2.05	2.26			89.24		
10/8/2003	8.10	7.19	6.83	-0.91	1.27			92.87		
17/8/2003	11.60	12.60	3.72	1.00	7.88			96.81		

ตารางภาคผนวก ค 3 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1 Std.	- 1 Std.	sell signal	buy signal	capital gain	sum stock	RSI	capital gain	sum stock
24/8/2003	11.00	58.60	-35.39	47.60	46.39			87.27		
31/8/2003	11.20	32.46	-10.34	21.26	21.54			87.73		
7/9/2003	11.60	11.93	10.51	0.33	1.09			88.69		
14/9/2003	12.20	12.59	10.62	0.39	1.58			90.03		
21/9/2003	1.25	14.10	10.39	12.85	-9.14			25.74		
28/9/2003	15.00	16.00	10.52	1.00	4.48	-1500.00	100	63.50		
5/10/2003	14.50	15.50	13.20	1.00	1.30			62.17		
12/10/2003	17.40	18.30	14.70	0.90	2.70			66.81		
19/10/2003	18.80	19.60	16.80	0.80	2.00			68.94		
26/10/2003	18.60	19.00	17.70	0.40	0.90			68.22		
2/11/2003	21.50	24.64	12.68	3.14	8.82			72.94		
9/11/2003	26.25	30.46	10.58	4.21	15.67			78.87		
16/11/2003	26.25	28.49	10.23	2.24	16.02			78.87		
23/11/2003	24.40	70.37	17.87	45.97	6.53			70.82		
30/11/2003	26.00	31.91	17.28	5.91	8.72			73.52		
7/12/2003	34.00	38.06	13.83	4.06	20.17			82.73		
14/12/2003	34.00	37.82	32.96	3.82	1.04			82.73		
21/12/2003	32.25	33.27	31.84	1.02	0.41			75.12		
28/12/2003	31.50	40.23	25.65	8.73	5.85			71.85		
4/1/2004	35.00	39.70	23.05	4.70	11.95			77.19		
11/1/2004	42.50	88.62	-18.57	46.12	61.07			84.48		
18/1/2004	47.00	52.75	46.38	5.75	0.62			87.29		
25/1/2004	49.50	52.71	47.13	3.21	2.37			88.61		
1/2/2004	37.00	39.61	36.85	2.61	0.15			55.38		
8/2/2004	44.25	46.49	42.73	2.24	1.52			64.33		
15/2/2004	46.00	50.02	42.86	4.02	3.14			66.22		
22/2/2004	44.25	49.75	37.66	5.50	6.59			62.41		

ตารางภาคผนวก ค 3 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1 Std.	- 1 Std.	sell signal	buy signal	capital gain	sum stock	RSI	capital gain	sum stock
29/2/2004	45.25	69.52	19.53	24.27	25.72			63.78		
7/3/2004	43.25	54.14	36.28	10.89	6.97			58.82		
14/3/2004	43.00	56.65	30.99	13.65	12.01			58.17		
21/3/2004	39.25	50.39	37.52	11.14	1.73			48.80		
28/3/2004	38.00	112.23	-33.85	74.23	71.85			45.95		
4/4/2004	40.00	73.42	1.84	33.42	38.16			51.21		
11/4/2004	40.75	67.65	12.91	26.90	27.84			53.18		
18/4/2004	40.75	57.30	27.43	16.55	13.32			53.18		
25/4/2004	37.00	48.40	33.09	11.40	3.91			41.91		
2/5/2004	32.00	84.45	-11.24	52.45	43.24			31.61		
9/5/2004	31.00	34.26	28.04	3.26	2.96			29.91		
16/5/2004	29.25	60.62	2.83	31.37	26.42			26.99	-2925.00	100
23/5/2004	30.75	46.73	14.77	15.98	15.98			33.43	-3075.00	200
30/5/2004	33.00	39.44	23.84	6.44	9.16			42.24		
6/6/2004	31.75	41.95	25.00	10.20	6.75			38.94		
13/6/2004	30.00	41.99	17.38	11.99	12.62			34.57		
20/6/2004	30.25	35.88	25.92	5.63	4.33			35.76		
27/6/2004	32.50	32.02	29.23	-0.48	3.27			45.95		
4/7/2004	34.75	45.82	18.24	11.07	16.51	3475.00	0	54.31		
11/7/2004	37.75	71.95	-2.16	34.20	39.91			63.10		
18/7/2004	35.25	88.94	-14.23	53.69	49.48			53.25		
25/7/2004	34.75	62.14	8.03	27.39	26.72			51.40		
1/8/2004	33.00	38.32	29.30	5.32	3.70			45.07		
8/8/2004	34.00	34.34	31.18	0.34	2.82			49.20		
15/8/2004	32.50	41.34	27.61	8.84	4.89			43.54		
22/8/2004	32.50	46.97	18.22	14.47	14.28			43.54		
29/8/2004	37.00	37.70	26.65	0.70	10.35			61.31		

ตารางภาคผนวก ค 3 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1 Std.	- 1 Std.	sell signal	buy signal	capital gain	sum stock	RSI	capital gain	sum stock
5/9/2004	35.75	123.27	-50.78	87.52	86.53			55.69		
12/9/2004	37.00	76.12	-6.46	39.12	43.46			59.93		
19/9/2004	40.50	60.40	13.32	19.90	27.18			69.39		
26/9/2004	40.00	106.12	-26.11	66.12	66.11			66.79		
3/10/2004	43.00	67.02	12.98	24.02	30.02			73.62		
10/10/2004	46.75	82.79	3.76	36.04	42.99			79.66	9350.00	0
17/10/2004	41.00	117.86	-25.05	76.86	66.05			56.70		
24/10/2004	40.25	149.14	-67.01	108.89	107.26			54.34		
31/10/2004	37.00	79.55	0.69	42.55	36.31			44.99		
7/11/2004	38.00	63.32	11.43	25.32	26.57			48.15		
14/11/2004	41.25	54.02	23.07	12.77	18.18			57.36		
21/11/2004	40.75	74.08	9.57	33.33	31.18			55.61		
28/11/2004	40.25	56.67	23.99	16.42	16.26			53.72		
5/12/2004	43.50	41.14	39.23	-2.36	4.27			63.13		
12/12/2004	41.75	83.54	3.13	41.79	38.62			56.05		
19/12/2004	41.00	65.93	18.06	24.93	22.94			53.10		
26/12/2004	40.00	44.57	36.64	4.57	3.36			49.13		
						2071.00	0		3397.00	0

ที่มา: จากการคำนวณ

ตารางภาคผนวก ค 4 สถานการณ์จำลองการซื้อขายหลักทรัพย์ BECL ด้วยการวิเคราะห์ทางเทคนิค

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1 Std.	- 1 Std.	sell signal	buy signal	capital gain	sum stock	RSI	capital gain	sum stock
2/1/2000	18.50							47.16		
9/1/2000	17.75	19.28	17.72	1.53	0.03			40.76		
16/1/2000	17.00	18.48	17.02	1.48	-0.02			35.24		
23/1/2000	18.00	17.60	16.40	-0.40	1.60	-1800.00	100	46.40		
30/1/2000	17.50	18.77	17.23	1.27	0.27	1750.00	0	42.21		
6/2/2000	16.25	18.59	16.66	2.34	-0.41			33.48		
13/2/2000	15.75	17.11	15.64	1.36	0.11	-1575.00	100	30.56		
20/2/2000	12.50	16.93	14.23	4.43	-1.73			18.48		
27/2/2000	12.00	15.13	10.03	3.13	1.97	-1200.00	200	17.27	-1200.00	100
5/3/2000	11.00	18.11	6.35	7.11	4.65			15.00	-1100.00	200
12/3/2000	11.25	11.72	10.49	0.47	0.76			18.10	-1125.00	300
19/3/2000	10.75	12.68	10.85	1.93	-0.10			16.70	-1075.00	400
26/3/2000	11.25	11.32	10.38	0.07	0.87	-1125.00	300	23.55	-1125.00	500
2/4/2000	11.00	12.29	10.62	1.29	0.38			22.48	-1100.00	600
9/4/2000	11.00	11.37	10.58	0.37	0.42			22.48	-1100.00	700
16/4/2000	13.00	11.50	10.84	-1.50	2.16			47.73	-1300.00	800
23/4/2000	13.00	14.01	11.86	1.01	1.14	3900.00	0	47.73		
30/4/2000	12.00	15.52	10.64	3.52	1.36			39.22		
7/5/2000	11.25	12.46	11.53	1.21	-0.28			33.98		
14/5/2000	10.50	11.86	10.03	1.36	0.47	-1050.00	100	29.45		
21/5/2000	10.25	11.05	9.92	0.80	0.33			28.01	-1025.00	900
28/5/2000	9.70	10.75	10.10	1.05	-0.40			24.92	-970.00	1000
4/6/2000	10.00	10.19	9.46	0.19	0.54	-1000.00	200	29.79	-1000.00	1100
11/6/2000	9.90	10.61	9.54	0.71	0.36			29.07	-990.00	1200
18/6/2000	10.00	10.21	9.67	0.21	0.33			31.01	-1000.00	1300
25/6/2000	9.90	10.37	9.88	0.47	0.02			30.06		
2/7/2000	10.00	10.12	9.62	0.12	0.38			32.44		

ตารางภาคผนวก ค 4 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
9/7/2000	9.90	10.29	9.77	0.39	0.13			31.21		
16/7/2000	9.50	10.14	9.64	0.64	-0.14			26.57		
23/7/2000	8.40	9.80	9.27	1.40	-0.87	-840.00	300	18.05	-840.00	1400
30/7/2000	8.00	8.97	7.78	0.97	0.22	-800.00	400	15.91	-800.00	1500
6/8/2000	8.40	9.03	7.01	0.63	1.39			26.03	-840.00	1600
13/8/2000	8.20	8.81	8.12	0.61	0.08			24.34	-820.00	1700
20/8/2000	8.00	8.77	8.01	0.77	-0.01			22.65	-800.00	1800
27/8/2000	7.70	8.35	7.77	0.65	-0.07	-770.00	500	20.21	-770.00	1900
3/9/2000	7.70	7.97	7.31	0.27	0.39	-770.00	600	20.21	-770.00	2000
10/9/2000	6.90	8.04	7.44	1.14	-0.54			14.62	-690.00	2100
17/9/2000	6.80	7.36	6.57	0.56	0.23	-680.00	700	14.06	-680.00	2200
24/9/2000	6.10	7.50	6.22	1.40	-0.12			10.74	-610.00	2300
1/10/2000	6.30	6.45	5.73	0.15	0.57	-630.00	800	17.19	-630.00	2400
8/10/2000	6.00	6.99	5.89	0.99	0.11			15.28	-600.00	2500
15/10/2000	5.60	6.34	5.72	0.74	-0.12			13.05	-560.00	2600
22/10/2000	5.70	6.09	5.37	0.39	0.33	-570.00	900	16.56	-570.00	2700
29/10/2000	5.80	5.99	5.34	0.19	0.46			20.28	-580.00	2800
5/11/2000	5.90	6.11	5.63	0.21	0.27			24.18	-590.00	2900
12/11/2000	6.20	6.23	5.72	0.03	0.48			35.17	-620.00	3000
19/11/2000	6.10	6.46	5.95	0.36	0.15			33.31		
26/11/2000	5.80	6.36	5.80	0.56	0.00			28.17		
3/12/2000	5.70	6.04	5.55	0.34	0.15			26.59		
10/12/2000	5.60	5.93	5.39	0.33	0.21			24.97		
17/12/2000	5.60	5.85	5.38	0.25	0.22			24.97		
24/12/2000	5.60	5.88	5.41	0.28	0.19			24.97		
31/12/2000	6.00	5.85	5.38	-0.15	0.62			45.37		
7/1/2001	5.90	6.29	5.73	0.39	0.17	5310.00	0	42.07		

ตารางภาคผนวก ก 4 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1 Std.	- 1 Std.	sell signal	buy signal	capital gain	sum stock	RSI	capital gain	sum stock
14/1/2001	7.80	6.25	5.56	-1.55	2.24			77.67		
21/1/2001	8.90	8.94	6.67	0.04	2.23			84.17	26700.00	0
28/1/2001	9.60	11.76	5.91	2.16	3.69			86.96		
4/2/2001	10.00	10.91	8.32	0.91	1.68			88.31		
11/2/2001	9.60	10.48	8.89	0.88	0.71			78.85		
18/2/2001	10.00	9.79	9.04	-0.21	0.96			81.18		
25/2/2001	10.50	10.20	9.54	-0.30	0.96			83.76		
4/3/2001	10.50	11.03	9.85	0.53	0.65			83.76		
11/3/2001	10.00	11.03	9.99	1.03	0.01			70.84		
18/3/2001	9.70	10.19	9.61	0.49	0.09			64.00		
25/3/2001	9.60	9.96	9.23	0.36	0.37			61.71		
1/4/2001	9.60	9.84	9.34	0.24	0.26			61.71		
8/4/2001	9.60	9.92	9.45	0.32	0.15			61.71		
15/4/2001	10.00	9.87	9.40	-0.13	0.60			68.61		
22/4/2001	10.50	10.27	9.73	-0.23	0.77			75.09		
29/4/2001	10.50	10.90	10.09	0.40	0.41			75.09		
6/5/2001	10.50	10.93	10.10	0.43	0.40			75.09		
13/5/2001	11.00	10.67	10.20	-0.33	0.80			81.08		
20/5/2001	11.25	11.24	10.60	-0.01	0.65			83.39		
27/5/2001	11.50	11.74	10.76	0.24	0.74			85.44		
3/6/2001	10.75	11.85	11.16	1.10	-0.41			59.88		
10/6/2001	10.00	11.07	10.25	1.07	-0.25	-1000.00	100	44.51		
17/6/2001	10.25	10.58	9.31	0.33	0.94	-1025.00	200	49.50		
24/6/2001	10.00	10.70	9.71	0.70	0.29			44.85		
1/7/2001	10.00	10.45	9.80	0.45	0.20			44.85		
8/7/2001	9.90	10.36	9.86	0.46	0.04			42.71		
15/7/2001	9.30	10.09	9.61	0.79	-0.31			32.12		

ตารางภาคผนวก ค 4 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
22/7/2001	9.80	9.65	9.02	-0.15	0.78	-980.00	300	45.19		
29/7/2001	9.70	10.28	9.36	0.58	0.34	2910.00	0	43.27		
5/8/2001	9.90	10.13	9.34	0.23	0.56			48.34		
12/8/2001	9.80	10.24	9.74	0.44	0.06			45.97		
19/8/2001	9.90	9.99	9.45	0.09	0.45			48.86		
26/8/2001	10.25	10.18	9.66	-0.07	0.59			57.96		
2/9/2001	9.90	10.52	9.93	0.62	-0.03			48.09		
9/9/2001	10.25	10.27	9.59	0.02	0.66	-1025.00	100	56.61		
16/9/2001	9.20	10.53	9.91	1.33	-0.71			36.10		
23/9/2001	8.70	9.69	8.60	0.99	0.10	-870.00	200	30.10		
30/9/2001	8.90	9.62	7.89	0.72	1.01			35.08		
7/10/2001	9.10	9.18	8.51	0.08	0.59			40.01		
14/10/2001	9.20	9.56	8.99	0.36	0.21			42.52		
21/10/2001	9.20	9.56	8.98	0.36	0.22			42.52		
28/10/2001	9.10	9.41	8.94	0.31	0.16			40.27		
4/11/2001	8.60	9.29	8.82	0.69	-0.22			30.86		
11/11/2001	8.35	8.89	8.34	0.54	0.01	-835.00	300	27.19		
18/11/2001	9.10	8.72	8.01	-0.38	1.09			48.41	-910.00	100
25/11/2001	9.35	9.52	8.70	0.17	0.65	2805.00	0	53.61		
2/12/2001	9.60	10.07	8.79	0.47	0.81			58.45		
9/12/2001	9.65	9.94	9.35	0.29	0.30			59.42		
16/12/2001	9.40	9.80	9.26	0.40	0.14			52.33		
23/12/2001	9.45	9.60	9.12	0.15	0.33			53.61		
30/12/2001	9.75	9.66	9.18	-0.09	0.57			60.87		
6/1/2002	9.90	10.02	9.47	0.12	0.43			64.11		
13/1/2002	10.90	10.25	9.59	-0.65	1.31			78.08		
20/1/2002	10.90	11.39	10.38	0.49	0.52			78.08	1090.00	0

ตารางภาคผนวก ค 4 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1 Std.	- 1 Std.	sell signal	buy signal	capital gain	sum stock	RSI	capital gain	sum stock
27/1/2002	13.90	11.74	9.95	-2.16	3.95			91.42		
3/2/2002	14.20	16.44	11.31	2.24	2.89			91.98		
10/2/2002	14.90	20.45	7.62	5.55	7.28			93.18		
17/2/2002	15.80	15.53	14.27	-0.27	1.53			94.42		
24/2/2002	15.20	16.46	14.12	1.26	1.08			82.82		
3/3/2002	16.00	15.96	14.33	-0.04	1.67			85.55		
10/3/2002	16.40	16.29	15.42	-0.11	0.98			86.77		
17/3/2002	17.50	17.10	15.39	-0.40	2.11			89.55		
24/3/2002	15.70	18.39	16.64	2.69	-0.94			64.08		
31/3/2002	14.30	17.61	13.51	3.31	0.79	-1430.00	100	51.05		
7/4/2002	13.70	16.65	11.77	2.95	1.93			46.39		
14/4/2002	15.50	14.58	12.41	-0.92	3.09			59.27		
21/4/2002	15.60	17.17	14.44	1.57	1.16	1560.00	0	59.89		
28/4/2002	15.10	18.78	12.84	3.68	2.26			55.07		
5/5/2002	15.30	15.50	14.87	0.20	0.43			56.68		
12/5/2002	15.80	15.41	14.52	-0.39	1.28			60.73		
19/5/2002	15.80	16.27	15.40	0.47	0.40			60.73		
26/5/2002	16.70	16.65	15.19	-0.05	1.51			67.93		
2/6/2002	18.60	17.09	16.28	-1.51	2.32			77.83		
9/6/2002	18.90	20.07	16.85	1.17	2.05			79.01		
16/6/2002	19.40	21.64	16.17	2.24	3.23			80.96		
23/6/2002	16.90	19.78	18.76	2.88	-1.86			52.71		
30/6/2002	16.10	18.33	14.83	2.23	1.27	-1610.00	100	46.70		
7/7/2002	16.70	19.64	12.42	2.94	4.28			51.49		
14/7/2002	16.50	17.10	16.14	0.60	0.36			49.77		
21/7/2002	17.50	17.56	16.24	0.06	1.26			57.89		
28/7/2002	16.10	17.92	17.24	1.82	-1.14			45.90		

ตารางภาคผนวก ค 4 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
4/8/2002	16.40	16.99	14.99	0.59	1.41	-1640.00	200	48.54		
11/8/2002	16.30	17.99	14.84	1.69	1.46			47.65		
18/8/2002	16.80	16.58	15.81	-0.22	0.99			52.67		
25/8/2002	16.40	17.38	16.71	0.98	-0.31	3280.00	0	48.38		
1/9/2002	16.40	16.91	15.75	0.51	0.65	-1640.00	100	48.38		
8/9/2002	15.70	16.88	15.96	1.18	-0.26			40.68		
15/9/2002	16.00	15.95	15.25	-0.05	0.75	-1600.00	200	45.01		
22/9/2002	15.30	16.67	15.55	1.37	-0.25	3060.00	0	37.61		
29/9/2002	14.80	15.78	14.80	0.98	0.00	-1480.00	100	33.13		
6/10/2002	14.80	15.55	14.29	0.75	0.51			33.13		
13/10/2002	14.90	15.08	14.38	0.18	0.52			35.19		
20/10/2002	15.50	15.28	14.79	-0.22	0.71			46.57		
27/10/2002	15.60	15.90	15.26	0.30	0.34	1560.00	0	48.32		
3/11/2002	15.80	16.01	15.23	0.21	0.57			51.94		
10/11/2002	15.20	16.02	15.52	0.82	-0.32			41.80		
17/11/2002	15.30	15.46	14.79	0.16	0.51	-1530.00	100	43.90		
24/11/2002	15.80	15.72	14.87	-0.08	0.93			53.59		
1/12/2002	15.30	16.11	15.43	0.81	-0.13	1530.00	0	44.69		
8/12/2002	15.00	15.86	14.93	0.86	0.07	-1500.00	100	40.08		
15/12/2002	14.70	15.34	14.60	0.64	0.10			35.81		
22/12/2002	14.50	14.93	14.30	0.43	0.20			33.10		
29/12/2002	14.90	14.84	14.31	-0.06	0.59			43.05		
5/1/2003	14.90	15.23	14.70	0.33	0.20	1523.00	0	43.05		
12/1/2003	14.10	15.26	14.63	1.16	-0.53			30.84		
19/1/2003	14.20	14.50	13.73	0.30	0.47	-1420.00	100	33.56		
26/1/2003	14.60	14.78	13.51	0.18	1.09			43.76		
2/2/2003	14.60	14.92	14.30	0.32	0.30			43.76		

ตารางภาคผนวก ค 4 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1 Std.	- 1 Std.	sell signal	buy signal	capital gain	sum stock	RSI	capital gain	sum stock
9/2/2003	14.70	15.14	14.34	0.44	0.36			46.49		
16/2/2003	14.70	14.92	14.45	0.22	0.25			46.49		
23/2/2003	14.80	14.86	14.39	0.06	0.41			49.74		
2/3/2003	15.00	15.05	14.56	0.05	0.44			55.92		
9/3/2003	15.00	15.28	14.73	0.28	0.27			55.92		
16/3/2003	14.50	15.27	14.73	0.77	-0.23			39.68		
23/3/2003	14.70	14.75	14.19	0.05	0.51	-1470.00	200	46.81		
30/3/2003	15.30	15.05	14.29	-0.25	1.01			62.26		
6/4/2003	14.50	15.69	14.91	1.19	-0.41	2900.00	0	43.03		
13/4/2003	15.10	15.24	13.92	0.14	1.18	-1510.00	100	55.04		
20/4/2003	15.10	15.73	14.40	0.63	0.70			55.04		
27/4/2003	14.50	15.44	14.55	0.94	-0.05			42.98		
4/5/2003	15.00	14.92	14.35	-0.08	0.65	-1500.00	200	52.91		
11/5/2003	15.20	15.31	14.52	0.11	0.68	3040.00	0	56.41		
18/5/2003	14.90	15.56	14.83	0.66	0.07			49.97		
25/5/2003	15.20	15.30	14.66	0.10	0.54			55.79		
1/6/2003	15.50	15.43	14.85	-0.07	0.65			61.02		
8/6/2003	17.10	15.77	15.14	-1.33	1.96			77.44		
15/6/2003	18.10	18.16	16.13	0.06	1.97			82.70		
22/6/2003	18.80	20.34	15.79	1.54	3.01			85.44		
29/6/2003	19.70	19.81	17.67	0.11	2.03			88.21		
6/7/2003	21.50	20.38	18.47	-1.12	3.03			91.81		
13/7/2003	21.00	23.36	19.33	2.36	1.67			83.63		
20/7/2003	21.70	24.02	17.73	2.32	3.97			85.69		
27/7/2003	20.50	22.03	21.05	1.53	-0.55			68.61		
3/8/2003	21.80	21.20	19.11	-0.60	2.69	-2180.00	100	74.87		
10/8/2003	23.60	23.40	20.31	-0.20	3.29	2360.00	0	80.94		

ตารางภาคผนวก ค 4 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1 Std.	- 1 Std.	sell signal	buy signal	capital gain	sum stock	RSI	capital gain	sum stock
17/8/2003	23.30	26.37	20.55	3.07	2.75			77.35		
24/8/2003	26.75	25.83	21.12	-0.92	5.63			85.75		
31/8/2003	23.00	29.45	23.50	6.45	-0.50			58.53		
7/9/2003	22.30	32.81	12.60	10.51	9.70	-2230.00	100	54.79		
14/9/2003	21.70	29.53	15.13	7.83	6.57			51.53		
21/9/2003	21.20	21.44	20.86	0.24	0.34			48.74		
28/9/2003	21.80	22.12	21.44	0.32	0.36			52.31		
5/10/2003	21.70	22.11	21.63	0.41	0.07			51.62		
12/10/2003	21.90	22.04	21.57	0.14	0.33			53.05		
19/10/2003	21.30	22.14	21.64	0.84	-0.34			48.12		
26/10/2003	21.20	21.61	20.98	0.41	0.22	-2120.00	200	47.27		
2/11/2003	22.00	21.65	20.80	-0.35	1.20			54.63		
9/11/2003	23.10	22.38	21.59	-0.72	1.51	4620.00	0	62.86		
16/11/2003	23.20	24.18	22.22	0.98	0.98			63.55		
23/11/2003	22.00	24.30	22.13	2.30	-0.13			50.50		
30/11/2003	22.60	22.41	21.33	-0.19	1.27	-2260.00	100	55.74		
7/12/2003	22.70	23.60	21.23	0.90	1.47	2270.00	0	56.63		
14/12/2003	23.90	23.35	22.05	-0.55	1.85			66.02		
21/12/2003	26.00	24.80	23.40	-1.20	2.60			76.36		
28/12/2003	25.00	28.03	23.73	3.03	1.27			65.42		
4/1/2004	25.00	27.74	22.17	2.74	2.83			65.42		
11/1/2004	24.00	25.40	24.20	1.40	-0.20			54.94		
18/1/2004	24.20	24.07	23.30	-0.13	0.90	-2420.00	100	56.55		
25/1/2004	23.50	25.00	23.70	1.50	-0.20			49.44		
1/2/2004	22.70	24.07	22.91	1.37	-0.21	-2270.00	200	42.40		
8/2/2004	23.10	23.58	22.09	0.48	1.01	-2310.00	300	46.77		
15/2/2004	24.50	23.61	22.42	-0.89	2.08			59.25		

ตารางภาคผนวก ค 4 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1	- 1	sell	buy	capital	sum	RSI	capital	sum
		Std.	Std.	signal	signal	gain	stock		gain	stock
22/2/2004	24.80	25.51	23.77	0.71	1.03	7440.00	0	61.49		
29/2/2004	25.25	26.68	23.19	1.43	2.06			64.82		
7/3/2004	25.50	25.52	24.90	0.02	0.60			66.68		
14/3/2004	25.50	25.62	24.88	0.12	0.62			66.68		
21/3/2004	23.40	25.80	25.15	2.40	-1.75			41.97		
28/3/2004	22.70	24.61	22.08	1.91	0.62	-2270.00	100	36.74		
4/4/2004	23.10	25.53	19.77	2.43	3.33			41.55		
11/4/2004	22.30	23.57	22.55	1.27	-0.25			35.35		
18/4/2004	23.20	23.21	22.08	0.01	1.12	-2320.00	200	45.84		
25/4/2004	22.60	23.94	22.68	1.34	-0.08			40.75		
2/5/2004	22.00	23.09	21.96	1.09	0.04	-2200.00	300	36.13		
9/5/2004	21.80	22.67	21.58	0.87	0.22			34.62		
16/5/2004	22.00	22.09	21.32	0.09	0.68			37.63		
23/5/2004	22.30	22.42	21.81	0.12	0.49			42.23		
30/5/2004	23.40	22.71	22.07	-0.69	1.33			55.97		
6/6/2004	22.90	23.99	22.92	1.09	-0.02			49.76		
13/6/2004	22.80	23.84	21.86	1.04	0.94	-2280.00	400	48.52		
20/6/2004	22.90	23.16	22.38	0.26	0.52			49.96		
27/6/2004	24.00	22.97	22.49	-1.03	1.51			63.08		
4/7/2004	23.60	24.75	23.43	1.15	0.17			56.83		
11/7/2004	24.00	24.96	22.26	0.96	1.74			61.26		
18/7/2004	24.00	24.38	23.58	0.38	0.42			61.26		
25/7/2004	24.00	24.17	23.41	0.17	0.59			61.26		
1/8/2004	23.90	24.33	23.83	0.43	0.07			58.94		
8/8/2004	22.40	24.12	23.55	1.72	-1.15			35.59		
15/8/2004	50.00	49.96	49.82	-0.04	0.18	-5000	3000	33.27		
22/8/2004	48.25	61.33	50.62	13.08	-2.37	144750	0	28.84		

ตารางภาคผนวก ค 4 (ต่อ)

การวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M								ดัชนีกำลังสัมพันธ์		
date	price	+ 1 Std.	- 1 Std.	sell signal	buy signal	capital gain	sum stock	RSI	capital gain	sum stock
29/8/2004	22.60	22.93	21.13	0.33	1.47			46.06		
5/9/2004	24.20	23.51	22.17	-0.69	2.03			62.17		
12/9/2004	23.60	25.34	23.39	1.74	0.21	14160.00	0	55.06		
19/9/2004	24.20	25.11	21.88	0.91	2.32			60.30		
26/9/2004	23.60	24.79	23.42	1.19	0.18			53.15		
3/10/2004	24.00	24.06	22.69	0.06	1.31			57.06		
10/10/2004	23.40	24.60	23.66	1.20	-0.26			49.85		
17/10/2004	23.00	23.92	22.64	0.92	0.36	-2300.00	100	45.43		
24/10/2004	23.30	23.61	22.56	0.31	0.74			49.32		
31/10/2004	22.60	23.48	22.91	0.88	-0.31			41.38		
7/11/2004	23.20	23.07	22.37	-0.13	0.83	-2320.00	200	49.43		
14/11/2004	24.00	23.74	22.76	-0.26	1.24	4748.00	0	58.25		
21/11/2004	24.00	24.53	23.40	0.53	0.60			58.25		
28/11/2004	24.90	24.74	23.45	-0.16	1.45			66.90		
5/12/2004	24.70	25.24	24.40	0.54	0.30			63.52		
12/12/2004	25.25	25.28	23.87	0.03	1.38			68.55		
19/12/2004	26.25	25.61	24.88	-0.64	1.37			75.61		
26/12/2004	26.00	26.96	25.27	0.96	0.73			71.01	2600.00	0
						31.00	0		1400.00	

ที่มา: จากการคำนวณ

ประวัติผู้เขียน

ชื่อ นางสาวพรกมล ปัญจะธง

วัน เดือน ปี เกิด 27 เมษายน 2524

ประวัติการศึกษา สำเร็จการศึกษามัธยมศึกษาตอนปลาย โรงเรียนนวมินทราชูทิศพายัพ
จังหวัดเชียงใหม่ ปีการศึกษา 2542
สำเร็จการศึกษาปริญญาบริหารธุรกิจบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
ปีการศึกษา 2546

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved