



ภาคผนวก

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved



ภาคผนวก ก

รายชื่อกลุ่มหลักทรัพย์ตามปัจจัยพื้นฐาน กลุ่มหลักทรัพย์ตามอุตสาหกรรม
และกลุ่มหลักทรัพย์สุ่มเลือก ตั้งแต่ปี พ.ศ.2551 ถึง พ.ศ.2555

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

ตาราง ก-1 แสดงรายชื่อกลุ่มหลักทรัพย์ตามปัจจัยพื้นฐาน กลุ่มหลักทรัพย์ตามอุตสาหกรรม และกลุ่มหลักทรัพย์สุ่มเลือก

ปี พ.ศ. 2551															
ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port
1	ACD	EE	AEONTS	21	LST	HANA	ERW	41	RPC	FMT	PATO	61	TISCO	PTL	SYNTEC
2	AIT	UVAN	APCS	22	LTX	ICC	EVER	42	SIAM	KKC	PB	62	TIW	NEP	TBSP
3	ASK	STA	BANPU	23	MANRIN	TR	FANCY	43	SRITHAI	BKI	PE	63	TK	ALUCON	TCMC
4	AYUD	STANLY	BCP	24	MBK	SUC	FE	44	SMIT	SCBLIF	PERM	64	TKS	GENCO	TGPRO
5	BAT-3K	SPG	BEC	25	MCS	AEONTS	GBX	45	SMK	THRE	PM	65	TMD	LH	THCOM
6	BJC	SAT	BIGC	26	MIPF	PE	GRAMMY	46	SPALI	BEC	PREB	66	TMT	CPN	TIC
7	BKKCP	BBL	BMCL	27	MK	ASP	IEC	47	SPCG	MCOT	PRIN	67	TNL	ITD	TISCO
8	CFRESH	KBANK	BUI	28	MODERN	CPF	JMART	48	SPG	SPORT	PTTGC	68	TOPP	AMATA	TLUXE
9	CHARAN	SCB	CCET	29	MSC	TUF	KBANK	49	SPORT	PDI	QHHR	69	TPA	MCS	TOG
10	CM	CPALL	CEI	30	OCC	KSL	KGI	50	SSC	TCP	RATCH	70	TPCORP	SSI	TPA
11	CPL	BIGC	CGS	31	OGC	BGH	KMC	51	SSF	UTP	RML	71	TRUBB	TSTH	TTI
12	CSL	ROBINS	CITY	32	P-FCB	BH	LALIN	52	SSSC	TOG	ROJNA	72	TSC	MANRIN	TTW
13	CTW	SCC	CNS	33	PATO	M-CHAI	MAJOR	53	SST	DSGT	SCC	73	TWFP	CENTEL	TU_PF
14	EASON	SCCC	CPN	34	PG	SIAM	MALEE	54	STA	S & J	SINGER	74	UP	OHTL	TWFP
15	FE	TPI	CWT	35	PL	KYE	MBK	55	SUC	TPA	SIS	75	UPF	AOT	TYCN
16	HEMARAJ	PTT	DCC	36	PR	OGC	MBKET	56	SVOA	VNT	SRITHAI	76	VNG	THAI	UT
17	JCT	PTTEP	DTC	37	PRANDA	ADVANC	MFEC	57	TBSP	TCB	SPORT	77	WG	PSL	UV
18	KKP	IRPC	EASTW	38	PRIN	INTUCH	NKI	58	TCAP	MIPF	SUPER				
19	LALIN	DELTA	EIC	39	QH	TRUE	NOBLE	59	TCCC	CPNRF	SVI				
20	LEE	CCET	EPCO	40	RCL	CTW	OISHI	60	TIF1	QHPF	SYMC				

ตาราง ก-1 แสดงรายชื่อกลุ่มหลักทรัพย์ตามปัจจัยพื้นฐาน กลุ่มหลักทรัพย์ตามอุตสาหกรรม และกลุ่มหลักทรัพย์สุ่มเลือก (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2552															
ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port
1	AH	UVAN	A	21	DRACO	PTT	CPI	41	MATI	CPF	LRH	61	PRANDA	SCBLIF	OCC
2	AIT	EE	AKR	22	DSGT	PTTEP	CPN	42	MBK	KSL	LTX	62	PRG	BKI	PAF
3	ALUCON	PRG	AMANAH	23	EASON	BANPU	CPNCG	43	MCS	TUF	MACO	63	PSL	THRE	PE
4	ASIMAR	STA	AMARIN	24	EASTW	IRPC	CPNRF	44	METCO	MALEE	MAKRO	64	PTL	TIP	PM
5	ASK	STANLY	AMATA	25	EGCO	RATCH	DCC	45	MFC	BGH	MANRIN	65	RATCH	BEC	POST
6	AYUD	SPG	APURE	26	FE	EGCO	DSGT	46	MIPF	BH	MATCH	66	RCL	LIVE	PRIN
7	BECL	SAT	AS	27	GL	DELTA	EASON	47	MK	M-CHAI	MAX	67	S & J	MCOT	QHHR
8	BFIT	IHL	ASIAN	28	GLOW	CCET	EMC	48	MODERN	SIKARIN	MCS	68	SAT	SPORT	RASA
9	BJC	BBL	BAFS	29	HANA	HANA	EPCO	49	MSC	SIAM	MDX	69	SC	PDI	SAM
10	BKKCP	KBANK	BFIT	30	HEMARAJ	TEAM	FNS	50	NKI	OGC	MINT	70	SIRI	TCP	SC
11	BSBM	SCB	BGH	31	IRPC	ICC	FSS	51	NNCL	FANCY	MJLF	71	SRITHAI	UTP	SCB
12	BUI	BAY	BWG	32	JCT	TR	GEL	52	NOBLE	KYE	MK	72	SMIT	TOG	SCBLIF
13	CCET	CPALL	CEI	33	JTS	SUC	GLOBAL	53	OGC	ADVANC	MNIT2	73	SMK	DSGT	SCC
14	CHARAN	BIGC	CEN	34	JUTHA	WACOAL	GOLD	54	P-FCB	DTAC	MNRF	74	SNC	S & J	SE_ED
15	CHOTI	ROBINS	CHOTI	35	KGI	AEONTS	GRAMMY	55	PAP	INTUCH	MONTRI	75	SPACK	JCT	SIM
16	CITY	BJC	CI	36	KKP	PE	HEMARAJ	56	PDI	TRUE	MSPF	76	SPALI	TPA	SINGER
17	CM	SCC	CK	37	KTC	ASP	INSURE	57	PF	CTW	NC	77	SPCG	VNT	SIS
18	CMR	SCCC	CMR	38	LEE	KTC	KCE	58	PG	KKC	NEW	78	SPG	TCB	SMIT
19	CPNRF	TPI	CPF	39	LRH	KGI	LHPF	59	PL	FMT	NMG	79	SSC	TCCC	SPACK
20	DELTA	DCC	CPH	40	LTX	MFC	LPN	60	PR	VARO	NWR	80	SSF	MIPF	SPG

ตาราง ก-1 แสดงรายชื่อกลุ่มหลักทรัพย์ตามปัจจัยพื้นฐาน กลุ่มหลักทรัพย์ตามอุตสาหกรรม และกลุ่มหลักทรัพย์สุ่มเลือก (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2552															
ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port
81	SSI	CPNRF	SPI	101	TPA	SSI	TTTM								
82	SSSC	QHPF	SPORT	102	TPCORP	MANRIN	TUF								
83	STA	TFUND	SPPT	103	TSC	OHTL	TWP								
84	SUC	FUTUREPF	STA	104	TTA	ERW	URBNPF								
85	TBSP	MONTRI	STANLY	105	TUF	LRH	WHA								
86	TCAP	PTL	STPI	106	TWFP	AOT	WIN								
87	TFUND	NEP	SUSCO	107	UP	THAI	WORK								
88	THANI	ALUCON	SVH	108	VNG	TTA	YCI								
89	TIF1	TFI	TCIF	109	WG	PSL	ZMICO								
90	TIP	BWG	TCOAT												
91	TISCO	GENCO	TCP												
92	TIW	LH	TF												
93	TK	CPN	THAI												
94	TKS	ITD	TNPC												
95	TKT	PS	TRUBB												
96	TLUXE	QH	TRUE												
97	TMD	AMATA	TSTE												
98	TMT	MCS	TTCL												
99	TOG	TSTH	TTL												
100	TOPP	GSTEL	TTLPF												

ตาราง ก-1 แสดงรายชื่อกลุ่มหลักทรัพย์ตามปัจจัยพื้นฐาน กลุ่มหลักทรัพย์ตามอุตสาหกรรม และกลุ่มหลักทรัพย์สุ่มเลือก (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2553															
ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port
1	AEONTS	UVAN	ACD	21	CPNRF	SCC	CSL	41	IRC	WACOAL	GRAND	61	MFEC	OGC	MBK
2	AIT	GFPT	ADVANC	22	CSC	SCCC	DELTA	42	JCT	AEONTS	HMPRO	62	MIPF	CEI	MCOT
3	ALUCON	PRG	AJ	23	DELTA	TPI	DEMCO	43	KKP	ASP	INTUCH	63	MJD	ADVANC	MFC
4	AMARIN	STA	AMANAH	24	DRACO	DCC	DTAC	44	KTB	PE	IRPC	64	MK	DTAC	MIPF
5	AMATA	EE	AQUA	25	UP	CENTEL	VGI	45	KTC	MFC	IT	65	MNIT	INTUCH	MK
6	AP	SPG	AS	26	DRT	STPI	DTC	46	KWC	KTC	ITD	66	MODERN	TRUE	MNIT2
7	ASK	STANLY	ASIA	27	DSGT	PIT	DTCPF	47	KYE	CPF	JAS	67	MSC	THCOM	MNIT
8	AYUD	IHL	ASIMAR	28	EASON	PTTEP	EASON	48	LALIN	TUF	JMT	68	NKI	CTW	MPIC
9	BAFS	SAT	AYUD	29	EASTW	BANPU	EE	49	LANNA	KSL	JTS	69	NOBLE	KKC	MTI
10	BECL	GYT	BFIT	30	ECL	IRPC	EMC	50	UPF	AOT	VIBHA	70	P-FCB	FMT	NEP
11	BJC	SCB	BIGC	31	EGCO	RATCH	EPCO	51	LEE	TF	LALIN	71	PAP	VARO	NEW
12	BKKCP	BBL	BSBM	32	EPCO	DELTA	FANCY	52	LPN	TVO	LHBANK	72	PATO	TCJ	NOBLE
13	BUI	KBANK	BTC	33	FE	HANA	FSS	53	LST	BGH	LHPF	73	PF	SCBLIF	NTV
14	CCET	BAY	BTNC	34	GC	CCET	FUTUREPF	54	LTX	BH	LST	74	PL	BKI	NWR
15	CHARAN	KTB	CEI	35	GFPT	SVI	GEL	55	M-CHAI	M-CHAI	LUXF	75	VIBHA	THAI	WAVE
16	CHOTI	CPALL	CEN	36	GLOW	EIC	GFPT	56	MACO	BCH	M-CHAI	76	PR	THRE	OCC
17	CITY	BIGC	CI	37	HANA	ICC	GJS	57	MATI	SIKARIN	MACO	77	PRG	TIP	OFM
18	CM	HMPRO	CK	38	HEMARAJ	TR	GLAND	58	MBK	SIAM	MAJOR	78	PSL	AYUD	OGC
19	CPI	ROBINS	CNS	39	HFT	SABINA	GLOW	59	MBKET	MODERN	MATI	79	PTL	BEC	OISHI
20	CPL	BJC	CNT	40	IFEC	SUC	GOLD	60	MCS	FANCY	MAX	80	QH	SPORT	PAE

ตาราง ก-1 แสดงรายชื่อกลุ่มหลักทรัพย์ตามปัจจัยพื้นฐาน กลุ่มหลักทรัพย์ตามอุตสาหกรรม และกลุ่มหลักทรัพย์สุ่มเลือก (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2553															
ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port
81	RATCH	GRAMMY	PB	126	WORK	BECL	ZMICO	120	TPA	GJS	TVO				
82	ROBINS	MCOT	PF	101	SST	QHPF	SPF	121	TSC	MANRIN	TWFP				
83	ROJNA	POST	PSL	102	STA	FUTUREPF	SPPT	122	TTA	OHTL	UPF				
84	S & J	PDI	PTT	103	STPI	PTL	SSI	123	TUF	LRH	UVAN				
85	SAT	TCP	Q-CON	104	SVI	ALUCON	SUC	124	TWFP	SHANG	VARO				
86	SC	UTP	QHPF	105	TBSP	NEP	SUSCO	125	WG	TTA	WIN				
87	SFP	TOG	RAM	106	TCAP	AJ	TBSP								
88	SIRI	S & J	RATCH	107	TFUND	TFI	TCAP								
89	SIS	DSGT	ROH	108	THANI	BWG	TCC								
90	SIKARIN	JCT	S & J	109	TICON	GENCO	TGCI								
91	SMIT	OCC	SABINA	110	TIP	LH	THCOM								
92	SNP	TPA	SAUCE	111	TISCO	CPN	TIP								
93	SORKON	VNT	SCSMG	112	TIW	PS	TIPCO								
94	SPACK	TCB	SGP	113	TK	QH	TKS								
95	SPALI	TCCC	SIAM	114	TKT	ITD	TLUXE								
96	SPCG	WG	SIRI	115	TLUXE	AP	TPA								
97	SPF	MIPF	SNC	116	TMD	TSTH	TRUBB								
98	SPG	CPNRF	SORKON	117	TMT	MCS	TRUE								
99	SSF	TFUND	SPALI	118	TOG	SSI	TTCL								
100	VNT	PSL	WHAPF	119	TOPP	INOX	TTI								

ตาราง ก-1 แสดงรายชื่อกลุ่มหลักทรัพย์ตามปัจจัยพื้นฐาน กลุ่มหลักทรัพย์ตามอุตสาหกรรม และกลุ่มหลักทรัพย์สุ่มเลือก (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2554															
ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port
1	AEONTS	STA	A	21	GL	TR	GOLDPF	41	MODERN	SCBLIF	NOBLE	61	SSF	BWG	SVOA
2	AMARIN	GFPT	AEONTS	22	HANA	ICC	GUNKUL	42	NIPPON	BLA	NWR	62	SUSCO	GENCO	SYMC
3	AP	UVAN	AEC	23	IFEC	SUC	HEMARAJ	43	NKI	BKI	OISHI	63	SYNEX	LH	SYNTEC
4	ASK	STANLY	AH	24	JCT	AEONTS	IEC	44	NOBLE	BEC	PATO	64	THANI	CPN	TASCO
5	ASP	SPG	AI	25	JTS	PE	INET	45	P-FCB	SPORT	PF	65	TICON	PS	TCCC
6	AYUD	SAT	AMANAH	26	KGI	ASP	KKC	46	PAP	GRAMMY	PLE	66	TIP	SSI	TCMC
7	BCP	SCB	ASIAN	27	KKP	CPF	KTP	47	PF	PDI	PRECHA	67	TIW	MCS	TF
8	BECL	BBL	AYUD	28	KYE	TUF	LANNA	48	PL	TCP	PRIN	68	TK	TSTH	TKS
9	BUI	KBANK	BCP	29	LALIN	KSL	LIVE	49	PM	UTP	RPC	69	TMD	MANRIN	TPCORP
10	CHOTI	CPALL	Bland	30	LEE	BGH	M-STOR	50	PR	TOG	SABINA	70	TMT	OHTL	TPP
11	CITY	BIGC	BMCL	31	LST	BH	MCOT	51	PRANDA	DSGT	SAMART	71	TOG	LRH	TTI
12	CM	HMPRO	BSBM	32	LTX	M-CHAI	MDX	52	PRECHA	S & J	SCB	72	TSC	THAI	TWFP
13	CPI	SCC	CHARAN	33	MACO	KYE	MFEC	53	PRIN	TPA	SFP	73	TWFP	AOT	TYCN
14	CPL	SCCC	CPI	34	MBK	SIAM	MILL	54	PSL	VNT	SIRI	74	WG	BTS	TYM
15	CPNRF	TPI	CSL	35	MFC	ADVANC	MINT	55	PTL	MIPF	SMIT				
16	EASON	PTT	DCON	36	MIPF	DTAC	Mlink	56	QH	CPNRF	SMM				
17	EASTW	PTTEP	DRT	37	MJD	INTUCH	MNRF	57	RATCH	TFUND	SPALI				
18	ECL	BANPU	EE	38	MJLF	SNC	MSC	58	SC	PTL	STA				
19	EGCO	DELTA	EVER	39	MK	KKC	N-Park	59	SIRI	ALUCON	STANLY				
20	FE	HANA	FORTH	40	Mlink	CTW	NCH	60	SPG	AJ	SVI				

ตาราง ก-1 แสดงรายชื่อกลุ่มหลักทรัพย์ตามปัจจัยพื้นฐาน กลุ่มหลักทรัพย์ตามอุตสาหกรรม และกลุ่มหลักทรัพย์สุ่มเลือก (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2555															
ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port
1	AEONTS	STA	AAV	21	EASTW	DELTA	GENCO	41	METCO	ADVANC	NUSA	61	SC	VNT	SSF
2	AI	GFPT	BANPU	22	ECL	HANA	GLOBAL	42	MIPF	DTAC	PATO	62	SENA	MIPF	SVH
3	AMARIN	UVAN	BAY	23	EGCO	CCET	GLOW	43	MJLF	INTUCH	PF	63	SMIT	CPNRF	SYMC
4	ASK	STANLY	BCP	24	EPCO	TR	ICC	44	MK	SNC	PG	64	SPG	TFUND	SYNTEC
5	ASP	SPG	BECL	25	FE	ICC	IFS	45	MNIT	KKC	PL	65	SSSC	SPF	TCC
6	AYUD	SAT	BMCL	26	GL	SUC	IRPC	46	MSC	CTW	POST	66	SUC	QHPF	TCIF
7	BAT-3K	SCB	BSBM	27	GOLDPF	AEONTS	IT	47	NKI	BLA	PR	67	SUSCO	PTL	TCJ
8	BCP	BBL	BUI	28	HANA	ASP	IVL	48	NOBLE	SCBLIF	PRG	68	TCOAT	AJ	TGPRO
9	BECL	KBANK	BWG	29	HFT	MFC	KBS	49	OGC	BKI	PT	69	TFUND	ALUCON	THAI
10	BKKCP	CPALL	CCET	30	IFEC	KGI	KSL	50	P-FCB	BEC	QHPF	70	TIW	BWG	THANI
11	BSBM	BIGC	CFRESH	31	JCT	TK	KWC	51	PAP	SPORT	RCI	71	TK	GENCO	TIW
12	CCET	HMPRO	CGS	32	KCE	CPF	LANNA	52	PDI	GRAMMY	SAM	72	TKS	CPN	TLUXE
13	CGS	SCC	CPNCG	33	KGI	TUF	LH	53	PF	PDI	SC	73	TLUXE	LH	TMD
14	CHOTI	SCCC	CTARAF	34	KKP	KSL	LST	54	PG	TCP	SCG	74	TMD	PS	TPI
15	CNS	TPI	DEMCO	35	KYE	BGH	MAJOR	55	PL	UTP	SGP	75	TMT	HEMARAJ	TTIM
16	CNT	PTT	DTAC	36	LALIN	BH	MAX	56	PM	TOG	SINGER	76	TOG	ITD	TWS
17	CPL	PTTEP	DTCI	37	LEE	M-CHAI	MCS	57	PRANDA	DSGT	SMIT	77	TPA	QH	UOBKH
18	CPNRF	BANPU	DTCPF	38	LHK	KYE	MK	58	PRIN	S & J	SMM	78	TVI	MCS	UPF
19	CSP	IRPC	EMC	39	LTX	SIAM	NC	59	QH	IVL	SPF	79	TWFP	SSI	VIBHA
20	EASON	GLOW	FSS	40	MACO	MODERN	NEP	60	RATCH	TPA	SPG	80	TWZ	INOX	VNT

ตาราง ก-1 แสดงรายชื่อกลุ่มหลักทรัพย์ตามบัญชีพื้นฐาน กลุ่มหลักทรัพย์ตามอุตสาหกรรม และกลุ่มหลักทรัพย์สุ่มเลือก (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2555															
ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port	ลำดับ	Fun Port	Ind Port	Rand Port
81	UMI	MANRIN	WAT												
82	UP	CENDEL	WAVE												
83	UPF	LRH	WHAPF												
84	UT	THAI	WORK												
85	VNG	AOT	YCI												
86	WG	BTS	ZMICO												



ภาคผนวก ข

รายชื่อหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามหลักการของ Fama and French

ตั้งแต่ปี พ.ศ.2551 ถึง พ.ศ.2555

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

ตาราง ข-1 แสดงรายชื่อหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามหลักการของ Fama and French

ปี พ.ศ. 2551													
ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L	ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L
1	GSTEL	PRANDA	BKI	WAT	HTC	KTP	21	CNS	KTB	LPN	SMM	TWP	KDH
2	GJS	THAI	SAMART	AFC	TIC	ML	22	TFUND	IRPC	MAKRO	BTC	ASIAN	M-CHAI
3	LRH	SNC	SCG	CWT	PREB	TKS	23	TNPC	PRIN	MAJOR	TPP	ASK	EASON
4	ESTAR	SHANG	CK	F & D	TH	WAVE	24	STA	EASTW	AEONTS	TCJ	CHARAN	STPI
5	PF	ICC	TOP	YCI	TCMC	SOLAR	25	TSTH	GLAND	IT	MIDA	TNPC	TPA
6	MK	BECL	ERW	DTCI	RCI	AIT	26	GOLD	EGCO	LANNA	TIW	SUPER	PATO
7	SUC	VNG	GRAND	TTTM	FANCY	SPACK	27	TCAP	MCS	MBKET	DRACO	PRECHA	OCC
8	JAS	MBK	ROBINS	TC	KMC	SSSC	28	METCO	HEMARAJ	DCC	HFT	SAMCO	NWR
9	TPI	ZMICO	INTUCH	THIP	SORKON	TLUXE	29	VNT	RPC	MCOT	TOPP	UPF	SIKARIN
10	LTX	QH	AI	CPH	TVI	ACD	30	SVI	LEE	ROH	BTNC	JCT	CMR
11	SRITHAI	TCCC	ROJNA	NC	INET	EVER	31	TK	ALUCON	MILL	TRUBB	SMK	PG
12	TYCN	AH	AP	TTL	SPG	SPORT	32	SSC	N-Park	SF	NIPPON	TTI	AHC
13	BCP	AOT	HMPRO	AMANAH	CFRESH	AMC	33	CTW	TMB	THRE	UMI	TNITY	EPCO
14	SC	SIAM	LIVE	SUSCO	OGC	TRC	34	GOLDPF	BAY	TEAM	UTP	TFD	MSC
15	THCOM	SPALI	TIPCO	NSI	KC	TWFP	35	KKP	TASCO	RICH	BUI	AJ	TBSP
16	SIRI	TISCO	BIGC	TCOAT	TSI	TMT	36	MJLF	TTA	FORTH	FNS	TKT	TYM
17	SSI	IRC	LH	UT	THANI	CSP	37	CPF	UNIQ	BWG	SSF	PL	MFEC
18	TR	GRAMMY	NTV	CEN	BSBM	SPCG	38	CGS	VIBHA	ADVANC	VARO	UV	UPOIC
19	BLAND	BBL	TICON	SAWANG	PAP	GBX	39	AYUD	MFC	POST	TSTE	P-FCB	JUTHA
20	NOBLE	MODERN	UVAN	MLINK	TRU	NEP	40	BJC	TSC	SIM	CPL	BKKCP	WIN

ตาราง ข-1 แสดงรายชื่อหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามหลักการของ Fama and French (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2551													
ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L	ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L
41	INOX	AKR	AMATA	NEW	ROCK	GC	61	RCL	KBANK	BEC	TMD	WG	SMPC
42	KGI	NNCL	SCC	CSC	TOG	DEMCO	62	SPC	PS	BH		JTS	
43	TNL	DRT	PTTEP	CHOTI	FSS	NMG	63	NKI	ASP	CIMBT		ASIMAR	
44	SPF	DELTA	RS	CEI	SINGER	TCC	64		RATCH			MACO	
45	IEC	SCB	BCH	PRG	PR	MDX	65		PB			CM	
46	PTL	TIP	SCBLIF	KYE	TPCORP	SPPT	66		BMCL			MANRIN	
47	LOXLEY	CSL	CPALL	CSR	TGCI	EMC	67		CENTEL			FE	
48	TCB	CCET	SAMTEL	IFEC	UP	MNIT	68		SCSMG			S & J	
49	WACOAL	TUF	RAM	KCE	SIS	PAE	69		DSGT			CITY	
50	RML	TVO	SE_ED	GFPT	SMIT	TGPRO	70		HANA			WIJK	
51	DTC	SAT	BGH	BAT-3K	AQUA	PT	71		PDI			GEL	
52	SFP	ITD	WORK	BFIT	CPI	SEAFCO	72		OISHI			SYNTEC	
53	SPI	MJD	SCCC	GENCO	INSURE	IHL	73		SAUCE			SVOA	
54	CPNRF	STEC	CPN	CI	KWC	APURE	74		SVH			CCP	
55	MIPF	TF	MINT	ASIA	SCP	PE	75		BTS			UOBKH	
56	GYT	GLOW	EE	KAMART	DCON	EARTH	76		BAFS			FMT	
57	MATI	NCH	OHTL	ECL	MATCH	MALEE	77		STANLY			PAF	
58	LALIN	DTAC	TWZ	Q-CON	TIF1	MPIC	78		KSL			KKC	
59	TCP	AMARIN	PRINC	PERM	MAX	NUSA	79		A			CNT	
60	PLE	SNP	TRUE	TFI	GL	TWS	80		BANPU			RASA	

ตาราง ข-1 แสดงรายชื่อหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามหลักการของ Fama and French (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2551													
ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L	ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L
81		SAM			AEC								
82		PIT			LST								
83		PSL											

ตาราง ข-1 แสดงรายชื่อหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามหลักการของ Fama and French (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2552													
ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L	ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L
1	TPI	TCB	TEAM	AFC	BUI	TOG	21	PLE	ICC	SF	YCI	SMM	UNIQ
2	GSTEL	SPC	A	F & D	KC	MSC	22	SSI	ESSO	TTW	UTP	SAM	SSSC
3	BLAND	EGCO	INTUCH	CPH	TMD	SINGER	23	AH	TCP	SAUCE	BTC	UPF	TSC
4	LRH	SPALI	PTT	NSI	TPCORP	AHC	24	BCP	LEE	ROH	UMI	GENCO	OCC
5	GJS	BJC	IT	MIDA	PAF	MATI	25	RCL	CENTEL	SCC	TSTE	TTI	PG
6	TNPC	UV	GRAMMY	TTL	DRACO	PT	26	TCAP	GLAND	LH	TCJ	CHOTI	TKS
7	SUC	TISCO	MAJOR	TC	CSC	AIT	27	RML	IRPC	SCG	ESTAR	KTP	GEL
8	THCOM	TMT	ERW	TTIM	SVOA	SPCG	28	SVI	SHANG	BANPU	NOBLE	TNITY	MFC
9	SRITHAI	PTL	BKI	CWT	ROCK	KKC	29	JAS	SNC	TYM	SAWANG	AMC	DSGT
10	PF	MJD	MCOT	THIP	HFT	MCS	30	THAI	TUF	MAKRO	CI	SFP	SEAFCO
11	METCO	CCET	BIGC	CPL	PRECHA	ML	31	SSC	QH	DCC	MK	NIPPON	AKR
12	LALIN	STEC	MBKET	AMANAH	FANCY	SPACK	32	PRIN	PSL	RPC	TNPC	SUPER	SIKARIN
13	SIRI	PRANDA	LANNA	KYE	NEW	PM	33	KKP	STPI	SCSMG	NC	NWR	MDX
14	STA	EASTW	AMATA	ASIAN	ASIA	EASON	34	CPF	MBK	OISHI	UT	ASK	TPA
15	GOLD	NKI	UPOIC	KMC	CEN	TGCI	35	KGI	BBL	BCH	TIW	WIIK	TBSP
16	CNS	HANA	CSL	SUSCO	KCE	JCT	36	VNG	MODERN	SCCC	BTNC	SPG	GL
17	SC	PDI	WORK	DTCI	PAP	TWFP	37	TK	LST	THRE	VARO	FMT	NMG
18	TYCN	TFI	AI	WAT	TIC	SPORT	38	TR	HEMARAJ	CPALL	LTX	PR	MFEC
19	GFPT	MIPF	BWG	PREB	THANI	SIS	39	DTC	BAY	POST	INET	TH	WAVE
20	VNT	LOXLEY	AS	TPP	IFEC	MAX	40	AOT	ALUCON	CPN	TCMC	TVI	KDH

ตาราง ข-1 แสดงรายชื่อหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามหลักการของ Fama and French (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2552													
ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L	ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L
41	CTW	DELTA	BGH	TOPP	TFD	PATO	61	GYT	TCCC	BEC	RASA	FSS	MALEE
42	SPF	VIBHA	IEC	ECL	EVER	DEMCO	62	CPNRF	SNP	LIVE	SAMCO	MACO	SMPC
43	TTA	SAT	UVAN	KAMART	CEI	EPCO	63	WACOAL	TOP	N-Park	CFRESH	LHK	TWS
44	TFUND	SCB	SABINA	TCOAT	TKT	TRC	64	PRINC	DRT	TRUE		BAT-3K	
45	PRG	IRC	SAMTEL	SORKON	DCON	CSP	65		BAFS			AEC	
46	KTB	STANLY	FORTH	SSF	TSI	WIN	66		AEONTS			CPI	
47	CGS	SGP	RAM	MLINK	SCP	SPPT	67		AP			MATCH	
48	INOX	TIP	PTTEP	Q-CON	BKKCP	NUSA	68		PB			CITY	
49	MJLF	TASCO	TVO	RCI	PL	MNIT	69		PS			CNT	
50	ZMICO	CK	MINT	FNS	OGC	NTV	70		CIMBT			S & J	
51	TNL	ASP	SIM	JTS	P-FCB	PAE	71		DTAC			SYNEX	
52	NNCL	GLOW	ADVANC	TWP	SMIT	TGPRO	72		BMCL			CMR	
53	BTS	RATCH	SE_ED	BFIT	CHARAN	INSURE	73		TIPCO			M-CHAI	
54	GOLDPF	NCH	SCBLIF	TRUBB	ACD	PE	74		ITD			NEP	
55	SIAM	KBANK	IHL	HTC	TLUXE	GC	75		TMB			CM	
56	TSTH	TF	BH	MANRIN	UP	RS	76		HMPRO			KWC	
57	MTI	RICH	TWZ	CSR	ASIMAR	APURE	77		ROJNA			WG	
58	BECL	LPN	TCC	TRU	GBX	MPIC	78		ROBINS			BSBM	
59	AYUD	MILL	GRAND	SOLAR	AJ	AQUA	79		SVH			SMK	
60	SPI	AMARIN	OHTL	SYNTEC	UOBKH	EARTH	80		EE			JUTHA	

ตาราง ข-1 แสดงรายชื่อหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามหลักการของ Fama and French (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2552													
ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L	ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L
81		EMC			PERM								
82		KSL			CCP								
83		TICON			FE								
84		SAMART			TIF1								

ตาราง ข-1 แสดงรายชื่อหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามหลักการของ Fama and French (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2553													
ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L	ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L
1	TPI	MJLF	PIT	AFC	GEL	M-CHAI	21	THAI	STANLY	BANPU	NOBLE	SCP	AKR
2	BLAND	PRG	TIPCO	F & D	SIAM	MSC	22	GJS	ROJNA	TYM	BFIT	GBX	JCT
3	GSTEL	INOX	ALUCON	CPH	TTI	EMC	23	VNG	BAY	BIGC	TC	CSR	SIS
4	GOLD	MTI	AMARIN	MIDA	AEC	EASON	24	CTW	SMK	NTV	MANRIN	LHK	WAVE
5	SRITHAI	MATI	A	NSI	MALEE	BWG	25	SC	TNL	BGH	SUSCO	TMD	SPORT
6	LRH	HEMARAJ	TF	CWT	CEN	PG	26	VNT	SNC	HMPRO	FNS	DCON	TGCI
7	STA	SF	GL	SAWANG	PAP	FE	27	METCO	LUXF	INTUCH	INET	ASK	TWFP
8	MK	BECL	DRT	TTIM	THANI	NIPPON	28	KYE	PSL	UPOIC	HTC	ROCK	CM
9	THCOM	PTL	SNP	TPP	GENCO	MATCH	29	KGI	TFUND	BMCL	TCMC	UPF	RPC
10	LALIN	EGCO	SAMART	TTL	TNITY	PM	30	KKP	SENA	MNIT	TRUBB	CFRESH	SEAFCO
11	PF	TCCC	MCOT	THIP	KC	MFC	31	SSC	SHANG	TTW	UMI	RICH	WORK
12	SUC	CENTEL	IT	TCJ	OGC	SPACK	32	RCL	IRC	CPN	SAM	PAF	SSSC
13	CNS	ZMICO	KSL	VARO	ASIA	SPCG	33	SSI	TOG	PB	UTP	TVI	TPA
14	GLAND	TCP	MILL	UT	KMC	CMR	34	TCAP	EASTW	TTCL	PREB	P-FCB	OCC
15	PRIN	IRPC	TVO	DTCI	NEW	DSGT	35	AOT	QH	MAKRO	TCOAT	WIJK	SIKARIN
16	LTX	PR	SCC	TWP	TFD	AIT	36	BCP	BBL	ROH	RASA	NNCL	SPPT
17	SIRI	ASP	AS	KCE	PLE	MPIC	37	TYCN	MODERN	SCG	NC	NWR	KDH
18	ESTAR	ESSO	BKI	AMANAH	FANCY	AHC	38	TTA	LEE	SAUCE	RCI	BAT-3K	PE
19	TNPC	S & J	CSL	CI	BUI	MAX	39	CCET	HANA	GRAMMY	MLINK	PRINC	CCP
20	TR	TASCO	LH	BTC	TSSTE	ASIMAR	40	TCB	SPC	CIMBT	TIC	IFEC	WIN

ตาราง ข-1 แสดงรายชื่อหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามหลักการของ Fama and French (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2553													
ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L	ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L
41	DTC	CGS	THRE	SOLAR	SMIT	TPOLY	61	PDI	ERW	CPALL	ASIAN	CHARAN	TGPRO
42	SPG	TICON	SCCC	ACD	TPCORP	IEC	62	TISCO	CK	SABINA	CSC	NEP	EARTH
43	SFP	WACOAL	FORTH	DRACO	UOBKH	MFEC	63	TSTH	STEC	TWZ	SMM	CNT	SMPC
44	TK	DELTA	MINT	PRECHA	FMT	GC	64	SPI	TMB	BEC	SORKON	KKC	TWS
45	AYUD	MBK	DCC	CPL	JUTHA	TBSP	65	BJC	LST	OHTL		KWC	
46	PRANDA	NKI	BCH	TRU	SSPF	EPCO	66	MCS	UNIQ	GRAND		BKKCP	
47	GYT	TOP	IHL	TIW	CITY	DEMCO	67		PS			TH	
48	MJD	LOXLEY	PTTEP	TOPP	TSI	TEAM	68		KBANK			AJ	
49	CPNRF	GLOBAL	RAM	SVOA	TKT	PATO	69		AEONTS			PT	
50	GFPT	STPI	SAMTEL	SYNTEC	YCI	AQUA	70		MAJOR			TLUXE	
51	KTB	AP	BLA	RML	MACO	CSP	71		SGP			APURE	
52	BTS	AMATA	TRUE	JTS	SINGER	TRC	72		DTAC			TIF1	
53	SAT	BAFS	OISHI	TNPC	FSS	RS	73		SVI			MDX	
54	JAS	ITD	SCBLIF	SAMCO	ML	SUPER	74		VIBHA			UP	
55	GOLDPF	LPN	SIM	AMC	SSF	LIVE	75		TUF			WG	
56	SPF	EE	SE_ED	KTP	CEI	NUSA	76		NCH			TFI	
Z	CPF	MIPF	UVAN	BTNC	CHOTI	INSURE	77		GLOW			SYNEX	
58	UV	TIP	POST	Q-CON	EVER	PAE	78		MBKET			CPI	
59	BSBM	ICC	ADVANC	AH	PL	TCC	79		SCB			PERM	
60	SPALI	TMT	BH	ECL	HFT	N-Park	80		SVH			TSC	

ตาราง ข-1 แสดงรายชื่อหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามหลักการของ Fama and French (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2553													
ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L	ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L
81		SCSMG			NMG								
82		LANNA			WAT								
83		AI			KAMART								
84		ROBINS											
85		SMT											

ตาราง ข-1 แสดงรายชื่อหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามหลักการของ Fama and French (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2554													
ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L	ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L
1	TPI	WACOAL	SCG	MIDA	CEI	SOLAR	21	MJLF	RATCH	KSL	MLINK	NNCL	MFEC
2	GOLD	TCAP	ALUCON	AFC	JUTHA	TRC	22	METCO	SF	MCOT	TTL	SYNTEC	PAF
3	SRITHAI	CPNRF	SCB	CPH	SMIT	MFC	23	DTC	PSL	UPOIC	TWP	TH	TWFP
4	BLAND	STA	LPN	MALEE	PRINC	TSTE	24	GSTEL	IRPC	TTCL	TTI	KAMART	PM
5	PF	SSI	SGP	NSI	SSSC	Q-CON	25	VNT	TCCC	GRAMMY	VARO	NC	GL
6	ESTAR	MIPF	BIGC	TPP	AMC	HFT	26	BCP	A	FORTH	TCOAT	DCON	APURE
7	TNPC	INOX	TTW	CWT	UT	TEAM	27	SPI	GLAND	EE	TNPC	ASIAN	SPACK
8	LRH	PDI	DRT	TTTM	CITY	AI	28	CTW	BJC	SCC	GENCO	GOLDPF	UPF
9	THCOM	CENTEL	CSL	TCMC	SFP	WAT	29	TTA	LEE	SNP	HTC	MATI	EPCO
10	SC	UV	ROBINS	ASIA	FSS	PE	30	RCL	KCE	TVO	RML	CSC	WORK
11	MK	LOXLEY	TF	FNS	CHARAN	OCC	31	PRIN	ITD	GUNKUL	NEW	SINGER	N-Park
12	LALIN	BBL	TRUE	SAM	TSI	SSF	32	SSC	IRC	IT	PLE	TFD	DEMCO
13	KGI	TTLPF	STPI	BFIT	JTS	MPIC	33	TRU	AEONTS	ROH	ROCK	ASK	MNIT
14	TYCN	PTL	LH	BTNC	PREB	TPA	34	TR	TIP	CPN	SUSCO	BAT-3K	TYM
15	BTS	SPC	BKI	DTCI	PAP	TWS	35	AOT	HEMARAJ	THRE	SMM	SSPF	SEAFCO
16	SUC	S & J	TASCO	EARTH	YCI	CM	36	CGS	TMT	PS	LTX	ECL	GRAND
17	CNS	MILL	CPF	TCJ	NWR	MAX	37	AYUD	EASTW	TWZ	CI	BKKCP	RS
18	GJS	NCH	LANNA	ACD	F & D	TBSP	38	KKP	TICON	SAUCE	TPCORP	PL	NTV
19	THAI	KTB	BGH	TNITY	PT	SPPT	39	NUSA	BAY	POST	OGC	TIF1	AKR
20	NOBLE	KKC	RAM	THIP	BWG	KTP	40	BECL	DTAC	MINT	DRACO	WAVE	KDH

ตาราง ข-1 แสดงรายชื่อหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามหลักการของ Fama and French (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2554													
ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L	ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L
41	CCET	BAFS	SAMTEL	SVOA	THANI	INSURE	61	ICC	SAMART	SCBLIF	BTC	FANCY	CSR
42	JAS	TRUBB	BANPU	UTP	KWC	LIVE	62	AJ	QH	SABINA	PERM	IFEC	LUXF
43	SHANG	TIPCO	BMCL	SAMCO	WIJK	CCP	63	TSTH	SVI	DCC	TMD	WG	SMPC
44	SIRI	SAT	MAKRO	SIAM	MDX	GC	64	NKI	DELTA	ADVANC	TC	FE	TGPRO
45	GYT	PR	IVL	P-FCB	PRECHA	TCC	65	ASP	SMT	OHTL		RCI	
46	TNL	AMARIN	SYMC	BUI	CPL	PATO	66	SMK	PIT	BEC		TKT	
47	CEN	MBK	BCH	GEL	MSC	SUPER	67	TCP	SIS	CPALL		EASON	
48	TK	TOP	PTTEP	TVI	SENA	OFM	68		VIBHA			M-CHAI	
49	EGCO	MODERN	IHL	ML	AQUA	IEC	69		GFPT			EMC	
50	AH	TMB	SCCC	RASA	UP	SPCG	70		CFRESH			NMG	
51	PRANDA	TSC	PB	RICH	ASIMAR	TIC	71		MBKET			TFI	
52	SPG	SYNEX	SIM	UOBKH	MACO	SAWANG	72		AMATA			TLUXE	
53	TFUND	STANLY	UVAN	KC	TKS	PAE	73		AIT			MATCH	
54	MTI	AP	CIMBT	FMT	BSBM	JCT	74		ROJNA			ZMICO	
55	TCB	KYE	BLA	INET	CNT	NIPPON	75		GLOBAL			AHC	
56	MJD	SVH	BH	EVER	NEP	MANRIN	76		SPALI			UMI	
57	PRG	HANA	HMPRO	TIW	SORKON	IFS	77		ERW			RPC	
58	SPF	LST	INTUCH	TOPP	CHOTI	CSP	78		SNC			GBX	
59	VNG	MCS	SE_ED	SCP	PG	AMANAH	79		MAJOR			TOG	
60	ESSO	TISCO	OISHI	KMC	LHK	SPORT	80		GLOW			CMR	

ตาราง ข-1 แสดงรายชื่อหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามหลักการของ Fama and French (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2554													
ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L	ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L
81		KBANK			TPOLY								
82		UNIQ			SIKARIN								
83		CK			WIN								
84		DSGT											
85		TUF											
86		TGCI											
87		AS											
88		SCSMG											
89		STEC											

ตาราง ข-1 แสดงรายชื่อหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามหลักการของ Fama and French (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2555													
ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L	ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L
1	TPI	PSL	SIS	TWS	ASIAN	IFEC	21	TNL	ESSO	PTTEP	KC	NWR	RCI
2	BLAND	QH	BGH	ASIA	SIAM	CHOTI	22	BECL	LOXLEY	UVAN	THIP	CPI	MACO
3	GOLD	TRU	DSGT	CPH	UTP	CM	23	SIRI	TRUBB	SCC	NEW	WAVE	TWFP
4	MK	MTI	BJC	MIDA	TFD	WIN	24	CGS	NUSA	CSL	OGC	BKKCP	SPORT
5	PF	KYE	GLOBAL	AFC	GOLDFP	TPA	25	TR	BAY	DRT	LUXF	FMT	TEAM
6	ESTAR	CPNRF	WORK	MALEE	TCMC	MATCH	26	AOT	EARTH	IT	SMM	HTC	SIKARIN
7	TTA	KCE	TRUE	ACD	EVER	UMI	27	SC	EASTW	GRAMMY	GENCO	SMPC	CFRESH
8	RCL	GSTEL	KBS	SAM	PLE	TOG	28	METCO	TMT	SCCC	LALIN	MLINK	MDX
9	LTX	BBL	STEC	TWP	TTI	NKI	29	DTC	LST	BKI	CSR	IFS	PT
10	THCOM	S & J	TF	DTCI	CHARAN	YCI	30	TNPC	STANLY	IHL	GEL	CEN	UPF
11	SRITHAI	RATCH	FORTH	SAWANG	SYNTEC	CNT	31	BCP	KTB	TVO	SAMCO	TMD	TLUXE
12	SUC	VIBHA	LANNA	FNS	AMANAH	NIPPON	32	EGCO	PITGC	SAMTEL	MANRIN	PG	EPCO
13	LRH	LHBANK	MINT	TTTM	CPL	EMC	33	SHANG	MBK	SCSMG	TIC	ZMICO	CSP
14	NOBLE	HANA	MCOT	VARO	BFIT	AI	34	SPF	SSC	SAUCE	TPCORP	RASA	APCS
15	GJS	TK	TTCL	TGPRO	SSSC	TKS	35	MLF	SF	IVL	JUTHA	MATI	PM
16	SPI	ASP	RAM	TTL	AEC	APURE	36	NNCL	DELTA	CPF	PRIN	CEI	SORKON
17	TYCN	IRPC	AS	BTNC	THANI	TSI	37	ICC	ERW	BIGC	TNITY	WIJK	SPACK
18	CCET	AEONTS	SVH	CI	FANCY	TBSP	38	KKP	BAFS	SNC	KMC	TIF1	KTP
19	TSTH	AMARIN	SYMC	NSI	F & D	Q-CON	39	TCB	TMB	CPN	BWG	JTS	OCC
20	SSI	AP	STPI	TCOAT	SENA	NMG	40	CTW	PR	SCBLIF	PRINC	KAMART	WAT

ตาราง ข-1 แสดงรายชื่อหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามหลักการของ Fama and French (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2555													
ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L	ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L
41	KGI	CENTEL	CIMBT	PRECHA	SUSCO	MNIT	61	TFUND	TUF	SVI	TC	UT	INSURE
42	SPG	EE	SIM	DRACO	TNPC	SEAFCO	62	BTS	SYNEX	SABINA	TOPP	UP	N-Park
43	VNG	GLAND	ROBINS	SVOA	TH	MPIC	63	MIPF	CK	OHTL	MJD	WG	IEC
44	PDI	CMR	BCH	RICH	BAT-3K	MAX	64	AH	MODERN	ADVANC	GBX	PL	LIVE
45	POPF	SCG	DTAC	ML	SOLAR	ROCK	65	A	SCB	DCC	FSS	KWC	PAE
46	GYT	TICON	GUNKUL	PERM	ASIMAR	TRC	66	IRC	ITD	THRE		HFT	
47	THAI	PIT	PB	CITY	BSBM	MFC	67	INOX	GFPT	CPALL		NC	
48	TRIF	ALUCON	TCC	TIW	SCP	TYM	68	TTLPF	GLOW	BEC		PE	
49	PRANDA	TISCO	BMCL	NCH	EASON	DEMCO	69		MAJOR			SSF	
50	TCP	SMK	BH	AMC	AQUA	KDH	70		KSL			TKT	
51	AYUD	STA	SNP	TCJ	TVI	SPPT	71		TASCO			AHC	
52	LEE	TOP	BLA	SFP	TIPCO	PAF	72		LPN			FE	
53	TCAP	SAMART	MAKRO	CNS	DCON	ROH	73		PS			RPC	
54	MILL	SAT	RML	ECL	CSC	POST	74		UPOIC			LHK	
55	GRAND	TFI	INTUCH	INET	SMIT	AKR	75		LH			PREB	
56	PRG	SPALI	SE_ED	BUI	JCT	GC	76		TIP			GL	
57	SPC	TSC	SMT	UOBKH	SST	SUPER	77		SGP			SSPF	
58	ASK	KBANK	HMPRO	CWT	PAP	PATO	78		MCS			UV	
59	VNT	MBKET	SPCG	P-FCB	MFEC	CCP	79		NTV			UNIQ	
60	WACOAL	PTL	OISHI	TPP	MSC	OFM	80		ITW			BTC	

ตาราง ข-1 แสดงรายชื่อหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามหลักการของ Fama and French (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2555													
ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L	ลำดับ	B/H	B/M	B/L	S/H	S/M	S/L
81		AIT			TPOLY								
82		TCCC			TWZ								
83		HEMARAJ			TSTE								
84		JAS			NEP								
85		RS			SINGER								
86		KKC			M-CHAI								
87		ROJNA											
88		AMATA											
89		AJ											
90		TGCI											
91		BANPU											



ภาคผนวก ค

รายชื่อหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามอัตราผลตอบแทนในอดีต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

ตาราง ก-1 แสดงหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามอัตราผลตอบแทนในอดีต

ปี พ.ศ. 2551																			
ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo	ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo	ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo	ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo
1	LIVE	VIBHA	ASIA	SEAFCO	21	TOP	MFC	NC	SINGER	41	ASP	GYT	TSTE	TCMC	61	SE_ED	TMB	PL	TGCI
2	RICH	CK	MPIC	PAE	22	TSTH	DTAC	SIS	TFI	42	PRANDA	DTC	SPACK	TRU	62	CNS	AH	CHOTI	AMC
3	SCBLIF	CPF	PT	SUPER	23	HEMARAJ	AKR	IFEC	FMT	43	KBANK	CENTEL	NEW	EASON	63	LRH	NNCL	TRUBB	WAT
4	BANPU	STANLY	MDX	SMM	24	PTTEP	WORK	EPCO	SORKON	44	IRC	SSI	MALEE	CSP	64	EGCO	CIMBT	CMR	
5	TR	A	INSURE	SSSC	25	THCOM	BLAND	SPG	PERM	45	NCH	SPF	KCAR	SPCG					
6	TVO	SPI	PE	TTL	26	UVAN	EASTW	BAT-3K	GBX	46	CGS	GSTEL	CHARAN	TLUXE					
7	TTA	TYCN	IHL	TGPRO	27	GRAMMY	VNG	TNITY	UTP	47	SAT	CTW	UOBKH	ABC					
8	SNC	INOX	STPI	YCI	28	AP	SAMART	FSS	TPP	48	DELTA	GRAND	TWFP	PREB					
9	QH	TNL	DEMCO	CPH	29	ITD	SRITHAI	UPOIC	SAMCO	49	TCCC	LALIN	ML	AHC					
10	PTL	BMCL	DRACO	OCC	30	MBKET	EE	SMK	SCP	50	OHIL	GJS	GEL	RCI					
11	KGI	MK	EIC	VARO	31	TCB	HMPRO	TYM	NEP	51	AYUD	PRINC	TKS	SOLAR					
12	LANNA	TUF	NIPPON	TCOAT	32	UNIQ	RS	GL	ECL	52	LOXLEY	HANA	JUTHA	WIJK					
13	PIT	QHPP	TCC	SVOA	33	AMATA	POST	LST	ROCK	53	SVI	TSC	SPORT	KMC					
14	TEAM	ZMICO	APURE	KYE	34	LPN	TWZ	KCE	SAWANG	54	DSGT	BTS	PATO	NSI					
15	BCP	SIAM	JCT	TH	35	SCB	RML	ASIMAR	AFC	55	BAFS	AI	GENCO	PAF					
16	CPALL	PDI	TOG	HTC	36	BAY	TNPC	DTCI	UMI	56	ROJNA	LTX	GFPT	KAMART					
17	BJC	JAS	TRC	CFRESH	37	RCL	KTB	CSC	DCON	57	MCOT	N-Park	GC	EVER					
18	SVH	ESTAR	UV	M-CHAI	38	SF	GLAND	WAVE	KWC	58	BKI	SUC	SMIT	ASIAN					
19	DRT	SSC	CEN	TPCORP	39	MINT	SAMTEL	PRG	MIDA	59	KSL	PLE	KTP	JTS					
20	CCET	ICC	UT	ACD	40	PS	THAI	MFEC	MLINK	60	TISCO	IT	THIP	KKC					

ตาราง ก-1 แสดงหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามอัตราผลตอบแทนในอดีต (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2552																			
ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo	ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo	ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo	ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo
1	IEC	VNG	WAT	AFC	21	SCG	QH	CHOTI	NMG	41	LUXF	LALIN	MNIT	LHK	61	SCSMG	TPI	DTCI	KMC
2	LIVE	STANLY	AQUA	AMC	22	TNL	BAY	KWC	PREB	42	STPI	ASP	TSI	JUTHA	62	AMARIN	THAI	OGC	KTP
3	TFI	HANA	MAX	MSC	23	LST	MJD	TSTE	TRC	43	GOLDFP	MBKET	GC	PT	63	MODERN	BTS	CMR	NWR
4	OISHI	ESSO	PERM	TIC	24	SIM	KTB	SMK	DSGT	44	EIC	ROJNA	S & J	SVOA	64	CPNRF	RICH	TOPP	GBX
5	CIMBT	STEC	SST	Q-CON	25	GRAMMY	KKP	BUI	AMANAH	45	SCBLIF	SNC	SIKARIN	RS	65	NCH	PRIN	TPP	SOLAR
6	MILL	PTT	CEN	CNT	26	SVH	IRPC	ASIAN	TPCORP	46	DTAC	RML	CM	APURE	66	TVO	PRINC	BSBM	MDX
7	GFPT	CNS	GL	TGPRO	27	MIPF	AH	SMM	MCS	47	TNPC	CK	LTX	INET					
8	UVAN	HEMARAJ	TH	TRU	28	TWZ	AOT	CPI	SYNEX	48	GYT	THCOM	UP	F & D					
9	TCC	SIAM	CSP	NEP	29	SPC	PDI	TC	MK	49	ADVANC	ITD	JCT	MALEE					
10	POST	MINT	CEI	FMT	30	SAUCE	MAJOR	ABC	FSS	50	TCP	GOLD	OCC	WIN					
11	PRG	MCOT	HFT	TCJ	31	OHTL	NNCL	URBNPF	RCI	51	TUF	WORK	SSSC	KCE					
12	EMC	SCC	BTNC	PAF	32	WACOAL	TASCO	MNRF	BFIT	52	SAMTEL	TRUE	TWFP	PM					
13	SABINA	ERW	TCOAT	SAWANG	33	TF	LANNA	NUSA	FNS	53	FORTH	RCL	CHARAN	BTC					
14	ALUCON	TR	YCI	SPORT	34	A	AP	TWS	EVER	54	TYCN	TOP	TTIM	NOBLE					
15	CPALL	TCB	PATO	MPIC	35	CTARAF	BWG	EARTH	BAT-3K	55	SHANG	AMATA	TMD	SAM					
16	PB	TMB	SIS	PRECHA	36	TTW	TISCO	SMPC	BROCK	56	NKI	CCET	CSR	PE					
17	TMT	SAT	AJ	CI	37	RAM	Bland	NC	JTS	57	FUTUREPF	LPN	CSC	PAE					
18	JAS	BMCL	NEW	KDH	38	TFUND	TTA	WAVE	UT	58	MJLF	KGI	ML	MANRIN					
19	ICC	PSL	FE	UNIQ	39	TYM	TEAM	WG	AKR	59	VIBHA	PLE	TBSP	RASA					
20	IHL	SF	TGCI	ACD	40	SPI	TICON	MATCH	SYNTEC	60	BCH	EE	INSURE	SEAFCO					

ตาราง ก-1 แสดงหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามอัตราผลตอบแทนในอดีต (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2553																			
ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo	ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo	ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo	ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo
1	CGS	AEONTS	F & D	VARO	21	BLAND	SRITHAI	AH	HTC	41	SCC	GLOBAL	THANI	MNRF	61	AOT	SHANG	KAMART	TSI
2	UNIQ	SMK	GBX	CSC	22	THCOM	DTAC	TPCORP	BWG	42	BMCL	SCG	TRU	UP	62	HANA	TWZ	MANRIN	WAVE
3	KYE	GLAND	UMI	KWC	23	TCAP	TIP	NOBLE	TWP	43	HMPRO	ROH	BAT-3K	SSSC	63	LST	CTARAF	DEMCO	TTI
4	EE	S & J	AMANAH	BKKCP	24	TRUE	AMARIN	RCI	SUPER	44	CCET	BLA	AFC	CHARAN	64	MJD	GYT	SAWANG	WAT
5	CIMBT	JAS	PRECHA	WG	25	LANNA	TYCN	INET	EMC	45	TOP	OHIL	MDX	M-STOR	65	SCCC	GRAND	SIS	TCC
6	TASCO	BKI	CFRESH	YCI	26	BANPU	NKI	Q-CON	NEW	46	IRPC	ICC	PE	MALEE	66	SC	EIC	BTC	LIVE
7	TSTH	VIBHA	KKC	BUI	27	KTB	ADVANC	TGCI	AEC	47	CPN	FORTH	PRINC	JMART	67	PB	IHL	PLE	N-Park
8	PS	LTX	KCE	ASIMAR	28	LALIN	TNL	ASIAN	FE	48	STPI	SCSMG	CNT	BTNC					
9	SSI	THRE	SSF	ASIA	29	KKP	SVH	SOLAR	TIC	49	LOXLEY	AS	MLINK	TIF1					
10	TPI	AI	UT	CSP	30	THAI	MJLF	AIT	EPCO	50	MCS	MNIT	DTCI	AQUA					
11	LPN	BJC	SEAFCO	SMIT	31	SIRI	A	PREB	TH	51	INOX	MIPF	NC	SSPF					
12	PRIN	KCAR	RASA	TPA	32	SVI	SPC	NNCL	MONTRI	52	GJS	POST	SUSCO	PG					
13	QH	TOG	UPF	TBSP	33	DCC	PRANDA	TRUBB	INSURE	53	MCOT	SIM	SVOA	IEC					
14	SPALI	NCH	KMC	AKR	34	PR	TNPC	DSGT	NUSA	54	BAY	MODERN	NMG	OGC					
15	AP	RATCH	PM	TNPC	35	ROJNA	SAMART	CPL	TWS	55	AMATA	SMT	CI	CEI					
16	CPF	WACOAL	JTS	SIKARIN	36	MK	TIPCO	AMC	EARTH	56	TMB	SENA	ECL	SPPT					
17	BTS	SAMTEL	IFEC	ROCK	37	TTA	TTW	FSS	SMPC	57	KSL	LUXF	SYNEX	TCOAT					
18	CK	FUTUREPF	KTP	WIN	38	GOLD	TFUND	PATO	CPH	58	STA	SPI	NEP	URBNPF					
19	TISCO	SAUCE	SYNTEC	FNS	39	LH	RAM	PAP	EASON	59	BCP	GOLDPF	CM	SST					
20	STEC	MATI	NWR	DCON	40	SAT	QHOP	SPORT	MNIT2	60	TVO	TCP	FANCY	TPP					

ตาราง ก-1 แสดงหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามอัตราผลตอบแทนในอดีต (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2554																			
ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo	ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo	ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo	ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo
1	AJ	TMT	SPCG	MSC	21	KGI	SPI	UT	EARTH	41	DCC	GRAMMY	TCMC	GENCO	61	GSTEL	POST	TKT	EIC
2	STA	PF	TPP	MFEC	22	GFPT	INOX	CSC	MALEE	42	SUC	AMARIN	KDH	BAT-3K	62	KCAR	MILL	CPL	IEC
3	PTL	AP	CWT	M-STOR	23	STEC	ROJNA	NSI	SMPC	43	SPALI	SYMC	KCAR	AEC	63	ITD	TTA	YCI	WIN
4	TRUBB	VIBHA	MDX	GOLDPF	24	STPI	WACOAL	TOPP	MAX	44	CPALL	MIPF	SST	BTC	64	SIS	CGS	MACO	TGPRO
5	IVL	PRG	SORKON	AI	25	SGP	GOLD	Q-CON	MANRIN	45	MAKRO	NUSA	KWC	TNITY	65	CK	EE	HFT	EVER
6	JAS	BAY	TFI	TBSP	26	HEMARAJ	ESSO	JTS	INSURE	46	SRITHAI	TTLPF	AFC	SSPF	66	SVI	UNIQ	DRACO	GBX
7	GLOBAL	QHFP	ROCK	TPA	27	ROBINS	KSL	SSSC	SMM	47	KCE	A	KTP	PE	67	TR	TWZ	GRAND	LIVE
8	B/C	LALIN	CCP	MPIC	28	SAT	CCET	CPH	MNIT2	48	TVO	ERW	PATO	ASIA	68	SMK	NCH	VARO	AQUA
9	SSC	MINT	TCC	PT	29	TRUE	CTARAF	TC	PAF	49	TISCO	ROH	TTI	SSF					
10	THAI	LH	TCJ	GL	30	CPF	NKI	NMG	CITY	50	SF	TCIF	SUSCO	APURE					
11	TCCC	BH	CNT	FNS	31	MCS	SABINA	TWP	NEP	51	TK	OHIL	PAP	CSR					
12	SMT	SIM	N-Park	SAM	32	IHL	DTC	DCON	KMC	52	DELTA	SCCC	MLINK	LUXF					
13	SNC	LOXLEY	SOLAR	MONTRI	33	DRT	AOT	SCP	IFS	53	MODERN	BECL	RML	CM					
14	KKC	MK	SINGER	FANCY	34	TASCO	AEONTS	ABC	CSP	54	ASP	MJD	RASA	ASIMAR					
15	TRU	ADVANC	UTP	MNRF	35	AMATA	ICC	TLUXE	TFD	55	SCBLIF	TSTH	TIW	MNIT					
16	CEN	BCP	LHK	TWFP	36	TUF	BMCL	WORK	KC	56	KTB	THCOM	TNPC	ACD					
17	HMPRO	TFUND	NC	MATI	37	AH	TNL	SMIT	WAVE	57	TCAP	TIPCO	AKR	PRECHA					
18	CTW	CIMBT	HTC	SUPER	38	TCB	PSL	ITTM	AMANAH	58	AIT	GUNKUL	TCOAT	WAT					
19	VNT	GJS	PREB	MSPF	39	TMB	SHANG	ASK	TU_PF	59	SNP	QH	UMI	GEL					
20	VNG	UVAN	TRC	TWS	40	BLA	RATCH	JMART	SPORT	60	SYNEX	SCG	TTL	URBNPF					

ตาราง ก-1 แสดงหลักทรัพย์ที่จัดกลุ่มตามอัตราผลตอบแทนในอดีต (ต่อ)

ปี พ.ศ. 2555																			
ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo	ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo	ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo	ลำดับ	B/W	B/Lo	S/W	S/Lo
1	EARTH	SCG	MALEE	TLUXE	21	HMPRO	TCCC	MACO	MATI	41	HMPRO	IVL	SUPER	DEMCO	61	IT	GSTEL	ASIAN	UNIQ
2	RML	NNCL	KAMART	BSBM	22	ADVANC	VNG	M-CHAI	CPL	42	ADVANC	TCAP	UP	ZMICO	62	BEC	PS	DTCI	MJD
3	GUNKUL	SCBLIF	PT	LALIN	23	CPN	BTS	HTC	NMG	43	CPN	SGP	SSF	CM	63	RATCH	TVO	THANI	AKR
4	CENDEL	DTCPF	PAE	BTC	24	MAKRO	CCET	YCI	CPH	44	MAKRO	ALUCON	PAP	ACD	64	SSC	TRUBB	TTI	JTS
5	TGCI	CK	NEP	AMANAH	25	PR	TRUE	AEC	KC	45	BCP	QH	MIDA	MLINK	65	SPI	TSTH	VARO	CWT
6	GRAND	FORTH	TGPRO	TIW	26	GLOBAL	MBK	TFD	RPC	46	PF	TMB	MPIC	TCJ	66	CPALL	SSI	ROCK	RICH
7	BGH	MK	SUSCO	TRC	27	ESSO	STPI	BFIT	LHK	47	TPI	IHL	NSI	MDX	67	RAM	AJ	TVI	TWZ
8	SVH	MILL	AQUA	MAX	28	LOXLEY	METCO	NC	TEAM	48	LPN	KCE	TMD	URBNPF	68	AOT	PTL	IFEC	CEN
9	DSGT	QHPF	ASIMAR	TIPCO	29	BH	IRC	AFC	MATCH	49	BCH	TCB	SST	FSS	69	KBS	RCL	PM	TPP
10	THCOM	TSC	EVER	PRECHA	30	JAS	SRITHAI	CHOTI	AI	50	TF	NUSA	OCC	UTP	70	ASK	THAI	BROCK	GEL
11	BLA	TMT	OFM	CHARAN	31	INTUCH	ASP	SCP	HFT	51	SPALI	PDI	PE	SOLAR					
12	BIGC	OHIL	RASA	TSI	32	GFPT	HANA	APCS	WIJK	52	SAUCE	THRE	SIAM	TYM					
13	DTAC	TRU	INSURE	KDH	33	CPF	STANLY	Q-CON	KMC	53	INOX	AH	FE	PRIN					
14	PB	TASCO	JMART	UPF	34	S & J	BANPU	BAT-3K	SPACK	54	GRAMMY	SMT	MSC	POST					
15	SMK	KYE	SINGER	SAMCO	35	HEMARAJ	BMCL	UOBKH	TOG	55	SPCG	DELTA	EMC	SPPT					
16	SC	TTW	TKS	SYNTEC	36	SNP	SAT	GENCO	FNS	56	VNT	STA	TTL	OGC					
17	ROBINS	TICON	PAF	TH	37	TK	KKC	MFC	RCI	57	TTCL	GJS	CNT	GBX					
18	CMR	TCP	WIN	UMI	38	LTX	SUC	BWG	INET	58	AS	TFI	THIP	SEAFCO					
19	VIBHA	KGI	ABC	GOLDFP	39	TTLPF	OISHI	SORKON	LIVE	59	GLAND	CTW	BUI	LUXF					
20	SYNEX	GYT	CEI	TC	40	RS	LST	DCON	ECL	60	GOLD	ROJNA	TSTE	JUTHA					



ภาคผนวก ง

แสดงผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ที่สร้างขึ้น อัตราผลตอบแทนปราศจาก
ความเสี่ยง และค่า SMB, HML และ WML รายเดือน

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

ตาราง ง-1 แสดงผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ที่สร้างขึ้น อัตราผลตอบแทนปราศจากความเสี่ยง และค่า SMB, HML และ WML

ลำดับ	เดือน	Rf	Fun Port - Rf	Ind Port - Rf	Rand Port - Rf	Rm-Rf	SMB	HML	WML	ลำดับ	เดือน	Rf	Fun Port - Rf	Ind Port - Rf	Rand Port - Rf	Rm-Rf	SMB	HML	WML
1	1/1/2551	0.0001	-0.0451	0.005	0.0059	0.025	-0.0023	-0.0341	0.0274	21	1/9/2552	0.0006	0.0619	0.0573	0.0643	0.0148	0.018	0.0648	-0.0672
2	1/2/2551	-0.0004	-0.0343	-0.0379	-0.0374	-0.0626	0.0106	-0.0054	0.0153	22	1/10/2552	0.001	0.0832	0.1022	0.0983	0.1063	-0.0113	0.0278	-0.1149
3	1/3/2551	0.0003	0.0352	0.0341	0.0286	0.032	0.0126	0.0202	0.006	23	1/11/2552	-0.0001	-0.0065	-0.0135	-0.0124	-0.0734	0.0463	0.0204	0.0013
4	1/4/2551	0.0002	-0.0215	-0.0212	0.0202	-0.0307	0.0501	0.0317	-0.0208	24	1/12/2552	0.0003	0.0381	0.0369	0.0319	0.0434	0.0244	0.0047	0.0169
5	1/5/2551	0.0004	0.0244	0.0024	0.0414	0.0035	0.0506	0.0225	0.0027	25	1/1/2553	0.0002	0.0387	0.0322	0.0214	0.0295	0.0094	0.0245	0.012
6	1/6/2551	-0.0005	-0.03	-0.0508	-0.047	-0.0342	-0.0077	0.0057	0.0129	26	1/2/2553	-0.0002	-0.0017	-0.0267	-0.0226	-0.0553	0.0294	0.01	-0.0242
7	1/7/2551	-0.0007	-0.054	-0.061	-0.0658	-0.0589	0.0145	0.0062	-0.014	27	1/3/2553	0.0001	0.0254	0.018	0.0083	0.0291	-0.0153	0.0332	0.0212
8	1/8/2551	-0.0007	-0.0641	-0.0814	-0.0695	-0.1245	0.0572	0.0454	-0.0622	28	1/4/2553	0.0005	0.0489	0.0614	0.0462	0.1058	-0.0495	0.0353	0.0351
9	1/9/2551	-0.0003	0.0001	-0.0186	-0.0341	-0.0126	0.0036	0.0254	-0.0036	29	1/5/2553	-0.0003	-0.0197	-0.0184	-0.0252	-0.0522	0.0195	0.0124	-0.0375
10	1/10/2551	-0.0009	-0.0622	-0.0944	-0.0863	-0.1271	0.0367	0.0211	-0.016	30	1/6/2553	0.0001	0.0146	0.0087	0.0057	-0.0346	0.0098	0.0339	0.0058
11	1/11/2551	-0.0024	-0.2074	-0.242	-0.2394	-0.2519	0.0313	0.0065	-0.0221	31	1/7/2553	0.0008	0.0917	0.082	0.0758	0.0711	0.0033	0.0704	0.0669
12	1/12/2551	-0.001	-0.0827	-0.121	-0.0955	-0.1372	0.0336	0.0343	-0.0061	32	1/8/2553	0.001	0.0871	0.1079	0.1014	0.0776	0.022	0.1307	-0.0038
13	1/1/2552	0.0007	0.0972	0.1316	0.0726	0.1435	-0.0243	0.0206	-0.1537	33	1/9/2553	0.0004	0.022	0.0334	0.0433	0.0601	-0.0214	-0.0582	0.0419
14	1/2/2552	0	-0.0016	-0.03	-0.0044	-0.0541	0.0172	0.0039	-0.0353	34	1/10/2553	0.0001	0.0226	0.0379	0.0146	0.0594	-0.0312	-0.0174	0.0121
15	1/3/2552	-0.0003	-0.0264	-0.0492	-0.0318	-0.0315	0.01	-0.013	0.0878	35	1/11/2553	0.0002	0.0239	0.0327	0.0166	0.0202	0.0147	0.0078	0.0062
16	1/4/2552	0.0002	-0.0018	0.0128	0.0231	0.0276	-0.0143	0.0394	-0.0711	36	1/12/2553	-0.0001	0.0049	-0.0019	-0.0066	0.0094	0.0047	-0.0113	-0.0187
17	1/5/2552	0.0007	0.0963	0.1266	0.0693	0.1382	-0.0632	0.0446	-0.1363	37	1/1/2554	0.0003	0.0187	0.005	0.0265	0.0099	0.0134	-0.0199	0.0208
18	1/6/2552	0.0009	0.0964	0.1298	0.0858	0.1746	-0.0391	0.109	-0.1762	38	1/2/2554	-0.0005	-0.0262	-0.0598	-0.0456	-0.077	0.026	-0.0073	-0.0468
19	1/7/2552	0	-0.0029	0.0187	-0.0026	0.0252	-0.0129	0.0091	-0.01	39	1/3/2554	0	0.0093	0.0005	0.0006	0.0288	-0.0037	-0.0045	-0.0077
20	1/8/2552	0.0004	0.0501	0.053	0.0407	0.0686	-0.0122	0.0247	-0.0438	40	1/4/2554	0.0004	-0.0067	0.0433	0.042	0.0628	0.008	-0.0127	0.0054

ตาราง ง-1 แสดงผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ที่สร้างขึ้น อัตราผลตอบแทนปราศจากความเสี่ยง และค่า SMB, HML และ WML (ต่อ)

ลำดับ	เดือน	Rf	Fun Port - Rf	Ind Port - Rf	Rand Port - Rf	Rm-Rf	SMB	HML	WML
41	1/5/2554	0.0002	0.0254	0.0144	0.0188	0.0199	-0.0019	0.0029	0.0171
42	1/6/2554	-0.0002	0.0044	-0.0026	-0.0151	-0.033	0.0174	0.0347	-0.0386
43	1/7/2554	-0.0003	-0.0328	-0.0298	-0.029	-0.0314	0.0854	0.0712	-0.0956
44	1/8/2554	0.0007	0.0718	0.0976	0.0673	0.0899	-0.0297	0.0019	0.004
45	1/9/2554	-0.0004	-0.0474	-0.0743	-0.0425	-0.0743	0.0161	-0.0203	-0.0111
46	1/10/2554	-0.0018	-0.1608	-0.1774	-0.1848	-0.1956	0.0074	-0.0039	-0.0442
47	1/11/2554	0.0001	0.0018	0.0451	0.008	0.0917	0.0086	-0.0061	0.0335
48	1/12/2554	0.0006	0.0732	0.07	0.0626	0.0567	-0.0138	0.0017	0.0338
49	1/1/2555	0	0.0027	-0.004	0.0018	-0.0014	0.0109	0.0048	0.0106
50	1/2/2555	0.0005	0.0543	0.0603	0.0472	0.052	0.0054	0.0224	-0.0051
51	1/3/2555	0.0002	0.0221	0.0291	0.024	0.0649	-0.0123	-0.0412	0.0212
52	1/4/2555	0.0003	0.0098	0.0238	0.0254	0.0218	-0.03	-0.0162	0.0322
53	1/5/2555	0.0002	0.0202	0.0247	0.0161	0.017	0.002	-0.0165	-0.0038
54	1/6/2555	-0.0003	-0.0427	-0.085	-0.032	-0.0997	0.057	0.0003	0.0423
55	1/7/2555	0.0003	0.0344	0.0351	0.0266	0.0585	0.0054	-0.0248	0.0134
56	1/8/2555	0.0006	0.0491	0.0141	0.0617	0.0029	0.0612	-0.0084	-0.0393
57	1/9/2555	0.0002	0.0524	0.0311	0.0196	0.0211	0.0173	0.0399	0.0112
58	1/10/2555	0.0004	0.0594	0.0325	0.0437	0.0445	-0.0007	-0.0073	-0.0108
59	1/11/2555	0.0002	0.0197	0.0054	0.0181	-0.0088	0.0501	0.0016	-0.0071
60	1/12/2555	0.0001	0.0208	0.0127	0.0115	0.0199	0.0059	-0.0047	0.0074

ประวัติผู้เขียน

- ชื่อ-นามสกุล** นายเกรียงไกร ก้อนคำ
- วัน เดือน ปี เกิด** 1 กันยายน พ.ศ. 2529
- ประวัติการศึกษา** ปีการศึกษา 2547 สำเร็จการศึกษามัธยมศึกษาตอนปลาย
โรงเรียนพิริยาลัยจังหวัดแพร่
ปีการศึกษา 2552 สำเร็จการศึกษาปริญญาตรี
สาขาวิศวกรรมอุตสาหกรรม คณะวิศวกรรมศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- ประสบการณ์ทำงาน**
ปี 2552 – 2555 วิศวกรอุตสาหกรรม บริษัทเวสเทิร์นดิเจิตอล (ประเทศไทย)
นิคมบางปะอิน จังหวัดพระนครศรีอยุธยา



มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
rights reserved