

ภาคผนวก ข

ผลการทดสอบ Prospect Stochastic Dominance ด้วยวิธี LMW-Test

ตาราง ข.1

แสดงผลการทดสอบ First Order PSD ด้วยวิธี LMW-Test

กำหนด $F=CDF$ ของ P และ $G= CDF$ ของ Q

กำหนด $d=F-G$

P vs Q	FPSD			
	P-Value			
	P vs Q		Q vs P	
	Positive	Negative	Positive	Negative
	H1:d>0	H1:d>0	H1:d>0	H1:d>0
HANGSENG VS KOSPI50	0.044	0.024	0.84	0.887
HANGSENG VS NIKKEI225	0.013	0.552	0.882	0.052
HANGSENG VS SET50	0	0.115	0.786	0.012
HANGSENG VS STRAITS TIMES	0.496	0.199	0.042	0.22
HANGSENG VS TSEC50	0.009	0.1	0.892	0.331
KOSPI50 VS NIKKEI225	0.204	1	0.472	0.009
KOSPI50 VS SET50	0.009	0.854	0.689	0.002
KOSPI50 VS STRAITS TIMES	0.639	0.705	0	0.01
KOSPI50 VS TSEC50	0.192	0.763	0.734	0.082
NIKKEI225 VS SET50	0.06	0.258	0.821	0.348
NIKKEI225 VS STRAITS TIMES	0.501	0.078	0	0.725
NIKKEI225 VS TSEC50	0.553	0.227	0.803	1
SET50 VS STRATIS TIMES	0.426	0.006	0	0.545
SET50 VS TSEC50	0.764	0.103	0.149	0.794
STRAITS TIMES VS TSEC50	0	0.228	0.622	0.123

ตาราง ข.2

แสดงผลการทดสอบ Second Order PSD ด้วยวิธี LMW-Test

กำหนด $F=CDF$ ของ P และ $G= CDF$ ของ Q กำหนด $d=F-G$

P vs Q	SPSD			
	P-Value			
	P vs Q		Q vs P	
	Positive	Negative	Positive	Negative
	H1:d>0	H1:d>0	H1:d>0	H1:d>0
HANGSENG VS KOSPI50	0.319	0.265	1	1
HANGSENG VS NIKKEI225	0.034	0.621	0.773	0.033
HANGSENG VS SET50	0.003	0.559	0.745	0.007
HANGSENG VS STRAITS TIMES	0.587	0.258	0.298	0.494
HANGSENG VS TSEC50	0.024	0.497	1	0.059
KOSPI50 VS NIKKEI225	0.127	1	0.574	0.012
KOSPI50 VS SET50	0.001	1	0.708	0.002
KOSPI50 VS STRAITS TIMES	0.671	0.751	0.123	0.275
KOSPI50 VS TSEC50	0.077	0.765	0.685	0.05
NIKKEI225 VS SET50	0.031	0.557	0.741	0.103
NIKKEI225 VS STRAITS TIMES	0.669	0.02	0.006	1
NIKKEI225 VS TSEC50	0.41	0.205	1	1
SET50 VS STRATIS TIMES	0.671	0.003	0.002	0.598
SET50 VS TSEC50	0.704	0.039	0.045	1
STRAITS TIMES VS TSEC50	0.01	0.457	0.698	0.072

ตาราง ๓.3

แสดงผลการทดสอบ Third Order PSD ด้วยวิธี LMW-Test

กำหนด $F=CDF$ ของ P และ $G= CDF$ ของ Q กำหนด $d=F-G$

P vs Q	TPSD			
	P-Value			
	P vs Q		Q vs P	
	Positive	Negative	Positive	Negative
	H1:d>0	H1:d>0	H1:d>0	H1:d>0
HANGSENG VS KOSPI50	0.172	0.125	1	1
HANGSENG VS NIKKEI225	0.018	0.606	0.73	0.03
HANGSENG VS SET50	0	0.588	0.722	0.007
HANGSENG VS STRAITS TIMES	0.584	0.239	0.138	0.467
HANGSENG VS TSEC50	0.011	0.532	1	0.067
KOSPI50 VS NIKKEI225	0.176	1	0.552	0.008
KOSPI50 VS SET50	0.001	1	0.674	0.002
KOSPI50 VS STRAITS TIMES	0.651	0.729	0.025	0.132
KOSPI50 VS TSEC50	0.107	1	0.681	0.031
NIKKEI225 VS SET50	0.021	0.557	0.704	0.096
NIKKEI225 VS STRAITS TIMES	0.656	0.032	0.002	1
NIKKEI225 VS TSEC50	0.354	0.089	1	1
SET50 VS STRAITS TIMES	0.674	0.004	0	0.599
SET50 VS TSEC50	0.68	0.031	0.038	1
STRAITS TIMES VS TSEC50	0.001	0.47	0.68	0.147