

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญ	ช
สารบัญตาราง	ญ
สารบัญภาพ	ฎ
บทที่ 1 บทนำ	1
หลักการและเหตุผล	1
วัตถุประสงค์เพื่อการศึกษา	2
ประโยชน์ที่ได้รับจากการศึกษา	2
นิยามศัพท์	2
บทที่ 2 ทฤษฎีแนวคิดและวรรณกรรมที่เกี่ยวข้อง	4
ทฤษฎีแนวคิดที่เกี่ยวข้อง	4
วรรณกรรมที่เกี่ยวข้อง	12
บทที่ 3 ระเบียบวิธีการศึกษา	14
ขอบเขตของเนื้อหา	14
ขอบเขตประชากร	14
วิธีการศึกษา	15
การวิเคราะห์ข้อมูล	15
สมมุติฐานในการศึกษา	16
บทที่ 4 ผลการศึกษา	17
ผลการวิเคราะห์ทางเทคนิค	17
บทที่ 5 สรุปและข้อเสนอแนะ	41
สรุปผลการศึกษา	41
อภิปรายผล	44
ข้อค้นพบ	45

	หน้า
ข้อจำกัดของการศึกษา	45
ข้อเสนอแนะสำหรับการศึกษาต่อไป	46
บรรณานุกรม	47
ภาคผนวก	48
ประวัติผู้เขียน	103

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Chiang Mai University

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
4.1 จำนวนรอบการลงทุน ผลการลงทุน สัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของการวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ BAFS	18
4.2 จำนวนรอบการลงทุน ผลการลงทุน สัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของการวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ BANPU	20
4.3 จำนวนรอบการลงทุน ผลการลงทุน สัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของการวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ BCP	22
4.4 จำนวนรอบการลงทุน ผลการลงทุน สัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของการวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ COCO	24
4.5 จำนวนรอบการลงทุน ผลการลงทุน สัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของการวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ EGCOMP	26
4.6 จำนวนรอบการลงทุน ผลการลงทุน สัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของการวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ LANNA	28
4.7 จำนวนรอบการลงทุน ผลการลงทุน สัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของการวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ PTT	30
4.8 จำนวนรอบการลงทุน ผลการลงทุน สัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของการวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ PTTEP	32
4.9 จำนวนรอบการลงทุน ผลการลงทุน สัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของการวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ RATCH	34
4.10 จำนวนรอบการลงทุน ผลการลงทุน สัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของการวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ SUSCO	36
4.11 จำนวนรอบการลงทุน ผลการลงทุน สัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของการวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ UGP	38
4.12 อัตราผลตอบแทนเฉลี่ยต่อวัน ค่าส่วนเบี่ยงเบนมาตรฐาน และสัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงาน	40
5.1 ผลการวิเคราะห์ทางเทคนิคแยกแต่ละหลักทรัพย์กลุ่มพลังงาน	42
5.2 อัตราผลตอบแทนเฉลี่ยต่อวันสูงสุด ค่า SD ต่ำสุด และ CV ต่ำสุด	43

สารบัญภาพ

รูป	หน้า
2.1 กราฟแสดงการเคลื่อนตัวตามเทคนิค RSI และสัญญาณซื้อขาย	6
2.2 กราฟแสดงการเคลื่อนตัวตามเทคนิค Stochastic และสัญญาณซื้อขาย	7
2.3 กราฟแสดงการเคลื่อนตัวตามเทคนิค %R และสัญญาณซื้อขาย	8
2.4 กราฟแสดงการเคลื่อนตัวตามเทคนิค CCI และสัญญาณซื้อขาย	9
2.5 กราฟแสดงการเคลื่อนตัวตามเทคนิค MACD และสัญญาณซื้อขาย	10
4.1 กราฟแสดงผลการลงทุนจากการใช้เครื่องมือทางเทคนิคตัดสินใจลงทุนใน BAFS	19
4.2 กราฟแสดงค่าอัตราผลตอบแทนและค่าสัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของ BAFS	19
4.3 กราฟแสดงผลการลงทุนจากการใช้เครื่องมือทางเทคนิคตัดสินใจลงทุนใน BANPU	21
4.4 กราฟแสดงค่าอัตราผลตอบแทนและค่าสัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของ BANPU	21
4.5 กราฟแสดงผลการลงทุนจากการใช้เครื่องมือทางเทคนิคตัดสินใจลงทุนใน BCP	23
4.6 กราฟแสดงค่าอัตราผลตอบแทนและค่าสัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของ BCP	23
4.7 กราฟแสดงผลการลงทุนจากการใช้เครื่องมือทางเทคนิคตัดสินใจลงทุนใน COCO	25
4.8 กราฟแสดงค่าอัตราผลตอบแทนและค่าสัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของ COCO	25
4.9 กราฟแสดงผลการลงทุนจากการใช้เครื่องมือทางเทคนิคตัดสินใจลงทุนใน EGCOMP	27
4.10 กราฟแสดงค่าอัตราผลตอบแทนและค่าสัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของ EGCOMP	27
4.11 กราฟแสดงผลการลงทุนจากการใช้เครื่องมือทางเทคนิคตัดสินใจลงทุนใน LANNA	29
4.12 กราฟแสดงค่าอัตราผลตอบแทนและค่าสัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของ LANNA	29
4.13 กราฟแสดงผลการลงทุนจากการใช้เครื่องมือทางเทคนิคตัดสินใจลงทุนใน PTT	31
4.14 กราฟแสดงค่าอัตราผลตอบแทนและค่าสัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของ PTT	31
4.15 กราฟแสดงผลการลงทุนจากการใช้เครื่องมือทางเทคนิคตัดสินใจลงทุนใน PTTEP	33
4.16 กราฟแสดงค่าอัตราผลตอบแทนและค่าสัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของ PTTEP	33
4.17 กราฟแสดงผลการลงทุนจากการใช้เครื่องมือทางเทคนิคตัดสินใจลงทุนใน RATCH	35
4.18 กราฟแสดงค่าอัตราผลตอบแทนและค่าสัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของ RATCH	35
4.19 กราฟแสดงผลการลงทุนจากการใช้เครื่องมือทางเทคนิคตัดสินใจลงทุนใน SUSCO	37
4.20 กราฟแสดงค่าอัตราผลตอบแทนและค่าสัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของ SUSCO	37
4.21 กราฟแสดงผลการลงทุนจากการใช้เครื่องมือทางเทคนิคตัดสินใจลงทุนใน UGP	39

รูป	หน้า
4.22 กราฟแสดงค่าอัตราผลตอบแทนและค่าสัมประสิทธิ์ความแปรปรวนของ UGP	39
ภาคผนวก.1 ตัวอย่างกราฟเส้น RSI และกราฟแท่งเทียนของ BANPU	49
ภาคผนวก.2 ตัวอย่างกราฟเส้น RSI และกราฟแท่งเทียนของ BCP	50
ภาคผนวก.3 ตัวอย่างกราฟเส้น RSI และกราฟแท่งเทียนของ COCO	51
ภาคผนวก.4 ตัวอย่างกราฟเส้น RSI และกราฟแท่งเทียนของ EGCOMP	52
ภาคผนวก.5 ตัวอย่างกราฟเส้น RSI และกราฟแท่งเทียนของ LANNA	53
ภาคผนวก.6 ตัวอย่างกราฟเส้น RSI และกราฟแท่งเทียนของ PTT	54
ภาคผนวก.7 ตัวอย่างกราฟเส้น RSI และกราฟแท่งเทียนของ PTTEP	55
ภาคผนวก.8 ตัวอย่างกราฟเส้น RSI และกราฟแท่งเทียนของ RATCH	56
ภาคผนวก.9 ตัวอย่างกราฟเส้น RSI และกราฟแท่งเทียนของ SUSCO	57
ภาคผนวก.10 ตัวอย่างกราฟเส้น RSI และกราฟแท่งเทียนของ UGP	58
ภาคผนวก.11 ตัวอย่างกราฟเส้น MACD และกราฟแท่งเทียนของ BAFS	59
ภาคผนวก.12 ตัวอย่างกราฟเส้น MACD และกราฟแท่งเทียนของ BANPU	60
ภาคผนวก.13 ตัวอย่างกราฟเส้น MACD และกราฟแท่งเทียนของ BCP	61
ภาคผนวก.14 ตัวอย่างกราฟเส้น MACD และกราฟแท่งเทียนของ COCO	62
ภาคผนวก.15 ตัวอย่างกราฟเส้น MACD และกราฟแท่งเทียนของ EGCOMP	63
ภาคผนวก.16 ตัวอย่างกราฟเส้น MACD และกราฟแท่งเทียนของ LANNA	64
ภาคผนวก.17 ตัวอย่างกราฟเส้น MACD และกราฟแท่งเทียนของ PTT	65
ภาคผนวก.18 ตัวอย่างกราฟเส้น MACD และกราฟแท่งเทียนของ PTTEP	66
ภาคผนวก.19 ตัวอย่างกราฟเส้น MACD และกราฟแท่งเทียนของ RATCH	67
ภาคผนวก.20 ตัวอย่างกราฟเส้น MACD และกราฟแท่งเทียนของ SUSCO	68
ภาคผนวก.21 ตัวอย่างกราฟเส้น MACD และกราฟแท่งเทียนของ UGP	69
ภาคผนวก.22 ตัวอย่างกราฟเส้น Stochastic และกราฟแท่งเทียนของ BAFS	70
ภาคผนวก.23 ตัวอย่างกราฟเส้น Stochastic และกราฟแท่งเทียนของ BANPU	71
ภาคผนวก.24 ตัวอย่างกราฟเส้น Stochastic และกราฟแท่งเทียนของ BCP	72
ภาคผนวก.25 ตัวอย่างกราฟเส้น Stochastic และกราฟแท่งเทียนของ COCO	73
ภาคผนวก.26 ตัวอย่างกราฟเส้น Stochastic และกราฟแท่งเทียนของ EGCOMP	74
ภาคผนวก.27 ตัวอย่างกราฟเส้น Stochastic และกราฟแท่งเทียนของ LANNA	75
ภาคผนวก.28 ตัวอย่างกราฟเส้น Stochastic และกราฟแท่งเทียนของ PTT	76

รูป	หน้า
ภาคผนวก.29 ตัวอย่างกราฟเส้น Stochastic และกราฟแท่งเทียนของ PTTEP	77
ภาคผนวก.30 ตัวอย่างกราฟเส้น Stochastic และกราฟแท่งเทียนของ RATCH	78
ภาคผนวก.31 ตัวอย่างกราฟเส้น Stochastic และกราฟแท่งเทียนของ SUSCO	79
ภาคผนวก.32 ตัวอย่างกราฟเส้น Stochastic และกราฟแท่งเทียนของ UGP	80
ภาคผนวก.33 ตัวอย่างกราฟเส้น %R และกราฟแท่งเทียนของ BAFS	81
ภาคผนวก.34 ตัวอย่างกราฟเส้น %R และกราฟแท่งเทียนของ BANPU	82
ภาคผนวก.35 ตัวอย่างกราฟเส้น %R และกราฟแท่งเทียนของ BCP	83
ภาคผนวก.36 ตัวอย่างกราฟเส้น %R และกราฟแท่งเทียนของ COCO	84
ภาคผนวก.37 ตัวอย่างกราฟเส้น %R และกราฟแท่งเทียนของ EGCOMP	85
ภาคผนวก.38 ตัวอย่างกราฟเส้น %R และกราฟแท่งเทียนของ LANNA	86
ภาคผนวก.39 ตัวอย่างกราฟเส้น %R และกราฟแท่งเทียนของ PTT	87
ภาคผนวก.40 ตัวอย่างกราฟเส้น %R และกราฟแท่งเทียนของ PTTEP	88
ภาคผนวก.41 ตัวอย่างกราฟเส้น %R และกราฟแท่งเทียนของ RATCH	89
ภาคผนวก.42 ตัวอย่างกราฟเส้น %R และกราฟแท่งเทียนของ SUSCO	90
ภาคผนวก.43 ตัวอย่างกราฟเส้น %R และกราฟแท่งเทียนของ UGP	91
ภาคผนวก.44 ตัวอย่างกราฟเส้น CCI และกราฟแท่งเทียนของ BAFS	92
ภาคผนวก.45 ตัวอย่างกราฟเส้น CCI และกราฟแท่งเทียนของ BANPU	93
ภาคผนวก.46 ตัวอย่างกราฟเส้น CCI และกราฟแท่งเทียนของ BCP	94
ภาคผนวก.47 ตัวอย่างกราฟเส้น CCI และกราฟแท่งเทียนของ COCO	95
ภาคผนวก.48 ตัวอย่างกราฟเส้น CCI และกราฟแท่งเทียนของ EGCOMP	96
ภาคผนวก.49 ตัวอย่างกราฟเส้น CCI และกราฟแท่งเทียนของ LANNA	97
ภาคผนวก.50 ตัวอย่างกราฟเส้น CCI และกราฟแท่งเทียนของ PTT	98
ภาคผนวก.51 ตัวอย่างกราฟเส้น CCI และกราฟแท่งเทียนของ PTTEP	99
ภาคผนวก.52 ตัวอย่างกราฟเส้น CCI และกราฟแท่งเทียนของ RATCH	100
ภาคผนวก.53 ตัวอย่างกราฟเส้น CCI และกราฟแท่งเทียนของ SUSCO	101
ภาคผนวก.54 ตัวอย่างกราฟเส้น CCI และกราฟแท่งเทียนของ UGP	102