

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ญ
บทที่ 1 บทนำ	
ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.1 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	5
1.2 ประโยชน์ของการศึกษา	5
1.3 แหล่งที่มาของข้อมูลและขอบเขตการศึกษา	5
บทที่ 2 ทฤษฎีแนวคิด และวรรณกรรมปริทัศน์	6
2.1 ทฤษฎีบทข้อมูลอนุกรมเวลา	6
2.2 การทดสอบยูนิทรูท (unit root test)	8
2.3 การทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาว	11
2.4 การทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะสั้น	12
2.5 การทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล	13
2.6 สมมติฐาน	14
2.7 วรรณกรรมที่เกี่ยวข้อง	14
2.8 นิยามศัพท์เฉพาะ	19
บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย	23
3.1 การทดสอบความนิ่ง (unit root test)	23
3.2 การวิเคราะห์ความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาว	24
3.3 การวิเคราะห์ความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะสั้น	25
3.4 การทดสอบสมมติฐานเชิงเป็นเหตุเป็นผล	26

บทที่ 4 ข้อมูลทั่วไปของหลักทรัพย์	27
4.1 หลักทรัพย์ BECL	27
4.2 หลักทรัพย์ PSL	31
4.3 หลักทรัพย์ RCL	34
4.4 หลักทรัพย์ THAI	36
4.5 หลักทรัพย์ TTA	39
บทที่ 5 ผลการศึกษา	43
5.1 ผลการทดสอบความนิ่ง (unit root test)	43
5.2 ผลการทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาว	51
5.3 ผลการทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะสั้น ตามแบบจำลอง เอเรอร์ค้อเรกชัน และผลการทดสอบสมมติฐานเชิงเป็นเหตุเป็นผล	54
บทที่ 6 สรุปและข้อเสนอแนะ	60
6.1 บทสรุป	60
6.2 ข้อเสนอแนะ	62
เอกสารอ้างอิง	63
ภาคผนวก	66
ประวัติผู้เขียน	71

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
1.1 แสดงรายชื่อของหลักทรัพย์ในกลุ่มขนส่ง	4
5.1 แสดงผลการทดสอบ unit root test ของตัวแปรราคาหลักทรัพย์ในกลุ่มขนส่ง	45
5.2 แสดงผลการทดสอบ unit root test ของตัวแปรปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์ ในกลุ่มขนส่ง	48
5.3 แสดงผลการทดสอบความนิ่งของส่วนที่เหลือ (residual) จากสมการถดถอยใน การทดสอบการร่วมกันไปด้วยกันของหลักทรัพย์ในกลุ่มขนส่ง ในกรณีที่ราคา เป็นตัวแปรอิสระ และปริมาณการซื้อขายเป็นตัวแปรตาม	52
5.4 แสดงผลการทดสอบความนิ่งของส่วนที่เหลือ (residual) จากสมการถดถอยใน การทดสอบการร่วมกันไปด้วยกันของหลักทรัพย์ในกลุ่มขนส่ง ในกรณีที่ปริมาณ การซื้อขายเป็นตัวแปรอิสระ และราคาเป็นตัวแปรตาม	53
5.4 แสดงผลการประมาณค่าสัมประสิทธิ์ โดยใช้แบบจำลองเอเรอร์คอเรชันของ ตัวแปรต่างๆด้วยวิธี OLS โดยให้ D(volume) เป็น dependent variable	56
5.5 แสดงผลการประมาณค่าสัมประสิทธิ์ โดยใช้แบบจำลองเอเรอร์คอเรชันของ ตัวแปรต่างๆด้วยวิธี OLS โดยให้ D(Price) เป็น dependent variable	57
5.6 แสดงผลการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล (granger causality) ระหว่างตัวแปร ราคาและปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์	59