

สารบัญ

กิตติกรรมประกาศ

บทคัดย่อภาษาไทย

บทคัดย่อภาษาอังกฤษ

สารบัญภาพ

หน้า

ก

ง

จ

๗

บทที่ 1 บทนำ

1.1 หลักการ ทฤษฎีและเหตุผล

1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา

1.3 ประโยชน์ที่ได้รับจากการศึกษา

1.4 ขอบเขตการศึกษา

1.5 นิยามศัพท์

1.6 โครงสร้างของงานวิจัย

1.7 สรุป

1

5

5

5

5

6

7

บทที่ 2 แนวคิด ทฤษฎีและผลงานการศึกษาที่เกี่ยวข้อง

2.1 แนวคิดและทฤษฎี

2.2 เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง

8

13

บทที่ 3 ระเบียบการวิธีวิจัย

3.1 แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา

3.2 สมมติฐาน

3.3 วิธีการศึกษา

16

16

16

บทที่ 4 ผลการศึกษา

4.1 ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET Index) และ เงินลงทุน โดยตรงจากต่างประเทศ(FDI)	27
4.2 ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET Index) และผลิตภัณฑ์มวลรวมประชาชาติ (GDP)	30
4.3 ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET Index) และอัตราเงินเฟ้อ (Inflation rate)	33
4.4 ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET Index) และอัตราการว่างงาน Unemployment rate)	35
4.5 ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ประเทศอินโดนีเซีย (JCI) และเงินลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศ (FDI)	37
4.6 ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ประเทศอินโดนีเซีย (JCI) และผลิตภัณฑ์มวลรวมประชาชาติ (GDP)	40
4.7 ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ประเทศอินโดนีเซีย (JCI) และอัตราเงินเฟ้อ (Inflation rate)	42
4.8 ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ประเทศอินโดนีเซีย (JCI) และอัตราการว่างงาน(Unemployment rate)	45

บทที่ 5 สรุปผลการศึกษาและข้อเสนอแนะ

5.1 สรุปผลการศึกษา	48
5.2 ข้อเสนอแนะสำหรับนักลงทุน	49
5.3 ข้อเสนอแนะสำหรับการวิจัยครั้งต่อไป	49
เอกสารอ้างอิง	50
ภาคผนวก	
ผลการวิเคราะห์ความสัมพันธ์ copulas ด้วยโปรแกรม SPLUS	52
ประวัติผู้เขียน	69

สารบัญภาพ

รูป	หน้า
1.1 การเคลื่อนไหวของดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย	2
1.2 การเคลื่อนไหวของดัชนีตลาดหลักทรัพย์อินโดนีเซีย	2
1.3 อัตราการเจริญเติบโตของ GDP ของประเทศอินโดนีเซีย	3
1.4 อัตราการเจริญเติบโตของ GDP ของประเทศไทย	4
4.1 ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET Index) และ เงินลงทุน โดยตรงจากต่างประเทศ(FDI)	27
4.2 ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET Index) และผลิตภัณฑ์มวลรวมประชาชาติ (GDP)	30
4.3 ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET Index) และอัตราเงินเฟ้อ (Inflation rate)	33
4.4 ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET Index) และอัตราการว่างงาน (Unemployment rate)	35
4.5 ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ประเทศอินโดนีเซีย (JCI) และเงินลงทุน โดยตรงจากต่างประเทศ (FDI)	37
4.6 ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ประเทศอินโดนีเซีย (JCI) และผลิตภัณฑ์มวลรวมประชาชาติ (GDP)	40
4.7 ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ประเทศอินโดนีเซีย (JCI) และอัตราเงินเฟ้อ (Inflation rate)	42
4.8 ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ประเทศอินโดนีเซีย (JCI) และอัตราการว่างงาน (Unemployment rate)	45