

สารบัญ

	หน้า
บทคัดย่อ	(1)
กิตติกรรมประกาศ.....	(4)
สารบัญตาราง.....	(7)
สารบัญภาพประกอบ.....	(8)
บทที่	
1. บทนำ.....	1
1.1 ความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	6
1.3 ขอบเขตของการศึกษา.....	6
1.4 กรอบและวิธีการศึกษา	8
1.5 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ	22
1.6 ข้อมูลและแหล่งข้อมูล	23
2. ทฤษฎีที่ใช้ในการศึกษาและวรรณกรรมปริทรรศน์.....	24
2.1 ทฤษฎีที่ใช้ในการศึกษา	24
2.2 วรรณกรรมปริทรรศน์.....	28

3.	ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.....	35
3.1	ตลาดการเงินในประเทศไทย	35
3.2	ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.....	38
3.3	วิกฤติเศรษฐกิจทางการเงิน หรือวิกฤติแฮมเบอร์เกอร์.....	50
4.	ผลการศึกษา.....	52
4.1	ลักษณะของข้อมูลและโปรแกรมที่ใช้ในการทดสอบ.....	53
4.2	การทดสอบ Stationary	54
4.3	การทดสอบสัมประสิทธิ์อัตโนมัติสหสัมพันธ์ (Autocorrelation)	56
4.4	การทดสอบประสิทธิภาพของตลาดหลักทรัพย์.....	58
4.5	การทดสอบค่าความคลาดเคลื่อนจากการพยากรณ์ของ แบบจำลองต่างๆ	60
4.6	เปรียบเทียบการใช้แบบจำลองทั้งสาม โดยพิจารณาจากการวัดความ คลาดเคลื่อนของการพยากรณ์	70
5.	สรุปผลการศึกษาและข้อเสนอแนะ.....	71
5.1	สรุปผลการศึกษา	71
5.2	ข้อจำกัดทางการศึกษา	73
5.3	ข้อเสนอแนะทางนโยบาย และข้อเสนอแนะเพื่อการศึกษาในอนาคต	74
	บรรณานุกรม	76
	ภาคผนวก	
ก.	ภาพอัตราผลตอบแทน SET50 Index.....	83