

สารบัญตาราง

ตารางที่		หน้า
3.1	ประวัติความเป็นมาของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย	39
4.1	ผลการทดสอบ Unit Root	55
4.2	ผลการประมาณสมการถดถอยของอัตราผลตอบแทน SET50 Index ของข้อมูลทั้งหมด	56
4.3	ผลการประมาณสมการถดถอยของอัตราผลตอบแทน SET50 Index ช่วงก่อนเกิดวิกฤติ	57
4.4	ผลการประมาณสมการถดถอยของอัตราผลตอบแทน SET50 Index ช่วงหลังเกิดวิกฤติ.....	57
4.5	ผลการทดสอบประสิทธิภาพตลาดหลักทรัพย์ตลอดช่วงเวลาทดสอบ	58
4.6	ผลการทดสอบประสิทธิภาพตลาดหลักทรัพย์ช่วงก่อนวิกฤติเศรษฐกิจ ปี พ.ศ.2550.....	59
4.7	ผลการทดสอบประสิทธิภาพตลาดหลักทรัพย์ช่วงหลังวิกฤติเศรษฐกิจ ปี พ.ศ.2550.....	60
4.8	ผลการทดสอบแบบจำลอง Serial Correlation Coefficient ของแต่ละ สมการในช่วงเวลาทั้งหมด.....	61
4.9	ผลการทดสอบแบบจำลอง ARIMA ของแต่ละสมการในช่วงเวลาทั้งหมด	62
4.10	ผลการทดสอบแบบจำลอง GARCH ของแต่ละสมการในช่วงเวลาทั้งหมด	63
4.11	ผลการทดสอบแบบจำลอง Serial Correlation Coefficient ของแต่ละ สมการ (ก่อนเกิดวิกฤติ)	64
4.12	ผลการทดสอบแบบจำลอง ARIMA ของแต่ละสมการ (ก่อนเกิดวิกฤติ)....	65
4.13	ผลการทดสอบแบบจำลอง GARCH ของแต่ละสมการ (ก่อนเกิดวิกฤติ) ..	66
4.14	ผลการทดสอบแบบจำลอง Serial Correlation Coefficient ของแต่ละ สมการ (หลังเกิดวิกฤติ).....	67
4.15	ผลการทดสอบแบบจำลอง ARIMA ของแต่ละสมการ (หลังเกิดวิกฤติ)	68
4.16	ผลการทดสอบแบบจำลอง GARCH ของแต่ละสมการ (หลังเกิดวิกฤติ)...	69
4.17	การคำนวณค่าความคลาดเคลื่อนของแบบจำลอง	70