

ัจญณา กุลวานิช 2554: การศึกษาพฤติกรรมแห่ตามกันในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ปริญญาวิทยาศาสตรมหาบัณฑิต (การจัดการเทคโนโลยีอุตสาหกรรมเกษตร) สาขาการจัดการเทคโนโลยีอุตสาหกรรมเกษตร ภาควิชาเทคโนโลยีอุตสาหกรรมเกษตร
อาจารย์ที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์หลัก: ผู้ช่วยศาสตราจารย์ชน โสคติ บุญวร โสคติ, D.B.A.
104 หน้า

งานวิจัยนี้ได้ทำการตรวจสอบพฤติกรรมแห่ตามกันในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เพื่อเป็นแนวทางในการพัฒนาตลาดหลักทรัพย์ไทยและเป็นประโยชน์ต่อการตัดสินใจของนักลงทุนที่จะลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยต่อไป โดยการศึกษาที่ใช้ข้อมูลราคาปิดรายวันของข้อมูลหมวดธุรกิจ 22 ธุรกิจ จากวันที่ 2 มกราคม 2533 ถึงวันที่ 30 ธันวาคม 2553 พบว่า ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยมีพฤติกรรมแห่ตามกันเกิดขึ้น ซึ่งมีหมวดธุรกิจเงินทุนและหลักทรัพย์เป็นแหล่งกำเนิดพฤติกรรมแห่ตามกัน และมีอิทธิพลต่อการกระจายของผลตอบแทนในธุรกิจอื่นๆ ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เมื่อพิจารณาการเกิดพฤติกรรมแห่ตามกันในช่วงตลาดขึ้นและตลาดลงจะพบพฤติกรรมนี้เกิดขึ้นทั้งสองช่วง โดยส่วนใหญ่แล้วพฤติกรรมแห่ตามกันมักจะปรากฏให้เห็นได้ชัดในช่วงที่ตลาดขาขึ้นมากกว่าช่วงตลาดขาลง แต่เมื่อพิจารณาถึงผลของวิกฤตเศรษฐกิจต่อการเกิดพฤติกรรมแห่ตามกัน พบว่า ช่วงวิกฤตเศรษฐกิจของประเทศไทยปี พ.ศ. 2540 มีผลต่อการเกิดพฤติกรรมแห่ตามกันในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย แต่อย่างไรก็ตามช่วงวิกฤตเศรษฐกิจของประเทศสหรัฐอเมริกาแทบจะไม่ส่งผลกระทบต่อพฤติกรรมแห่ตามกันในประเทศไทยเลย

ลายมือชื่อนิสิต

ลายมือชื่ออาจารย์ที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์หลัก