

พฤษภาคม 2562: ปัจจัยที่มีผลผลกระทบต่อปัจจัยที่มีผลผลกระทบต่อดัชนีราคาหลักทรัพย์ SET 50 ช่วงก่อนและหลังจากที่ธนาคารกลางสหราชอาณาจักรเบี้ยนนโยบายเป็นครั้งแรก ปริญญาศึกษาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชาการเงินประยุกต์ อาจารย์ที่ปรึกษาการศึกษาค้นคว้าอิสระ: ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ณัฐวุฒิ คุณวนิชัย D.B.A., 95หน้า

การศึกษาค้นคว้าอิสระครั้งนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อศึกษาปัจจัยที่มีผลผลกระทบต่อดัชนีราคาหลักทรัพย์ SET 50 ช่วงก่อนและหลังจากธนาคารกลางสหราชอาณาจักรเบี้ยนนโยบายเป็นครั้งแรก โดยเก็บรวบรวมข้อมูลจากแหล่งข้อมูลทุกดิจิทัลที่เป็นข้อมูลสถิติ โดยใช้ข้อมูลแบบอนุกรมเวลา (Time Series) แบบรายวัน ตั้งแต่วันที่ 4 มกราคม พ.ศ. 2559 ถึง วันที่ 28 ขันวาคม พ.ศ. 2561 โดยใช้วิธีวิเคราะห์การถดถอยแบบเด็นตรงพหุคุณด้วยวิธีกำลังสองน้อยที่สุด นำผลมาเปรียบเทียบในช่วงก่อนและหลังเกิดเหตุการณ์

โดยปัจจัยที่ศึกษาได้แก่ อัตราแลกเปลี่ยนค่าเงินบาทต่อдолลาร์สหราชอาณาจักร (CUR) นิยมค่าการซื้อขายสุทธิของนักลงทุนสถาบัน (NDI) นิยมค่าการซื้อขายสุทธิของนักลงทุนต่างประเทศ (NFF) ดัชนีอุตสาหกรรมดาวโจนส์ (DJIA) และราคาน้ำมันดิบเบรนท์ (BRENT) จำนวนห้องสิ่น 5 ห้องแปร

จากการศึกษาพบว่า ในช่วงก่อนธนาคารกลางสหราชอาณาจักรเบี้ยนนโยบาย นิยมค่าการซื้อขายสุทธิของนักลงทุนสถาบัน (NDI) นิยมค่าการซื้อขายสุทธิของนักลงทุนต่างประเทศ (NFF) อัตราแลกเปลี่ยนค่าเงินบาทต่อдолลาร์สหราชอาณาจักร (CUR) และดัชนีอุตสาหกรรมดาวโจนส์ (DJIA) เป็นปัจจัยที่มีผลต่อดัชนีราคาหลักทรัพย์ SET 50 อย่างมีนัยสำคัญทางสถิติที่ 5% ส่วนราคาน้ำมันดิบเบรนท์ (BRENT) เป็นปัจจัยที่มีผลต่อดัชนีราคาหลักทรัพย์ SET 50 อย่างมีนัยสำคัญทางสถิติที่ 10% และในช่วงหลังจากธนาคารกลางสหราชอาณาจักรเบี้ยนนโยบาย นิยมค่าการซื้อขายสุทธิของนักลงทุนสถาบัน (NDI) และนิยมค่าการซื้อขายสุทธิของนักลงทุนต่างประเทศ (NFF) เป็นปัจจัยที่มีผลต่อดัชนีราคาหลักทรัพย์ SET 50 อย่างมีนัยสำคัญทางสถิติที่ 5% ส่วนอัตราแลกเปลี่ยนค่าเงินบาทต่อдолลาร์สหราชอาณาจักร (CUR) เป็นปัจจัยที่มีผลต่อดัชนีราคาหลักทรัพย์ SET 50 อย่างมีนัยสำคัญทางสถิติที่ 10%

พนิช

ลายมือชื่อนิสิต

พ

ลายมือชื่ออาจารย์ที่ปรึกษาการศึกษาค้นคว้าอิสระ

20, 7, 62