

ทศพด พระโพธิ์ 2562: ผลกระทบของกลุ่มหลักทรัพย์บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) ต่อราคารายวันของ SET 50 INDEX FUTURE ปริมาณสุก累平มาตราบัญชีต (การเงิน ประยุกต์) สาขาวิชาการเงินประยุกต์ ภาควิชาการเงิน อาจารย์ที่ปรึกษางานค้นคว้าอิสระ: ผู้ช่วยศาสตราจารย์ณัฐวุฒิ คุวัฒน์เรืองรัช, CFA, D.B.A. 76 หน้า

จุดประสงค์ของงานวิจัยในครั้งนี้ เพื่อศึกษาผลกระทบของกลุ่มหลักทรัพย์บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) ต่อราคารายวันของ SET 50 INDEX FUTURE ในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อให้เห็นถึงผลกระทบของกลุ่มหลักทรัพย์บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) และปัจจัยอื่นที่มีอิทธิพล ต่อราคารายวันของ SET 50 INDEX FUTURE โดยศึกษาตัวแปรอิสระ 9 ตัวแปร คือ จำนวนการซื้อขายสัญญาล่วงหน้าของนักลงทุนสถาบัน (VOPF) จำนวนการซื้อขายสัญญาล่วงหน้าของนักลงทุนต่างชาติ (VOFF) ปริมาณการซื้อขายหุ้นของนักลงทุนสถาบัน (VOPS) ปริมาณการซื้อขายหุ้นของนักลงทุนต่างชาติ (VOFS) ราคาของกลุ่มหลักทรัพย์บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) (GPTT) ราคาทองคำ (GOLD) ดัชนีนิกเกอิ (NIK) ราคาหุ้นกลุ่มหลักทรัพย์บริษัทชีพ จำกัด (มหาชน) (GCP) และดัชนีหุ้งเสียง (HSI) โดยใช้ข้อมูลรายวันในช่วง วันที่ 4 มกราคม พ.ศ. 2559 ถึง วันที่ 28 ธันวาคม พ.ศ. 2561 เนพะวันทำการของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย รวม 733 วันมาทำการวิเคราะห์ข้อมูล ด้วยสมการ回帰多变量 (Multiple Linear Regression)

ผลการศึกษาพบว่า ดัชนีหุ้งเสียง (HSI) ดัชนีนิกเกอิ (NIK) และราคาของกลุ่มหลักทรัพย์ บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) (GPTT) มีความสัมพันธ์ไปในทิศทางเดียวกันกับราคารายวันของ SET 50 INDEX FUTURE ในขณะที่จำนวนการซื้อขายสัญญาล่วงหน้าของนักลงทุนต่างชาติ (VOFF) และปริมาณการซื้อขายหุ้นของนักลงทุนต่างชาติ (VOFS) มีความสัมพันธ์ไปในทิศทางตรง ข้ามกับราคารายวันของ SET 50 INDEX FUTURE อย่างมีนัยสำคัญทางสถิติ ระดับนัยสำคัญทางสถิติร้อยละ 99 ส่วนทางด้านตัวแปรที่เหลือคือราคาทองคำ (GOLD) ราคาของกลุ่มหลักทรัพย์ บริษัทชีพ จำกัด (มหาชน) (GCP) จำนวนการซื้อขายสัญญาล่วงหน้าของนักลงทุนสถาบัน (VOPF) และปริมาณการซื้อขายหุ้นของนักลงทุนสถาบัน (VOPS) พบร่วมกับความสัมพันธ์กับราคารายวันของ SET 50 INDEX FUTURE โดยตัวแปรอิสระในสมการมีความสามารถในการอธิบายตัวแปร ตามได้ร้อยละ 29.35 ($R^2 = 0.2935$)

กศว

๗ ๗

๗ / ๗ / ๖๒

ลายมือชื่อนิสิต

ลายมือชื่ออาจารย์ที่ปรึกษา