

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ก
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ฉ
สารบัญภาพ	ฉ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	3
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ	3
1.4 ขอบเขตของการศึกษา	3
1.5 แหล่งที่มาของข้อมูล	5
1.6 นิยามศัพท์	5
บทที่ 2 ผลงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	7
บทที่ 3 แนวคิดทฤษฎี ระเบียบวิธีวิจัย	
3.1 แนวคิดทฤษฎี	11
3.2 ระเบียบวิธีวิจัย	18
3.2.1 รูปแบบของการวิเคราะห์	18
3.2.2 ระเบียบวิธีวิจัย	26
บทที่ 4 ผลการศึกษา	
4.1 การวิเคราะห์เปรียบเทียบการส่งสัญญาณการซื้อขายที่ได้จากการ	31
4.1.1 สัดส่วนความถูกต้องของสัญญาณซื้อขายจากเครื่องมือเส้น ดัชนีกำลังสัมพัทธ์	31

4.1.2	สัดส่วนความถูกต้องของสัญญาณซื้อขายจากเครื่องมือ เส้นค่าเฉลี่ยเคลื่อนที่สองเส้น	34
4.1.3	สัดส่วนความถูกต้องของสัญญาณซื้อขายจากเครื่องมือ เส้นสโตแคสติกส์แบบช้า	38
4.1.4	สัดส่วนความถูกต้องของสัญญาณซื้อขายจากเครื่องมือ เส้นสโตแคสติกส์แบบเร็ว	41
4.1.5	สัดส่วนความถูกต้องของสัญญาณซื้อขายจากเครื่องมือ เส้นสโตแคสติกส์แบบปรับปรุง	45
4.2	การวิเคราะห์เปรียบเทียบผลตอบแทนที่ได้จากการลงทุนในหลักทรัพย์ จากการใช้สัญญาณซื้อขายที่ได้จากเครื่องมือการวิเคราะห์ทางเทคนิค	50
4.2.1	ผลตอบแทนในหลักทรัพย์จากการใช้เครื่องมือ เส้นดัชนีกำลังสัมพัทธ์	51
4.2.2	ผลตอบแทนในหลักทรัพย์จากการใช้เครื่องมือ เส้นค่าเฉลี่ยเคลื่อนที่สองเส้น	52
4.2.3	ผลตอบแทนในหลักทรัพย์จากการใช้เครื่องมือ เส้นสโตแคสติกส์แบบช้า	53
4.2.4	ผลตอบแทนในหลักทรัพย์จากการใช้เครื่องมือ เส้นสโตแคสติกส์แบบเร็ว	54
4.2.5	ผลตอบแทนในหลักทรัพย์จากการใช้เครื่องมือ เส้นสโตแคสติกส์แบบปรับปรุง	56
4.3	การวิเคราะห์เปรียบเทียบหาเครื่องมือในการวิเคราะห์หลักทรัพย์ ทางเทคนิคที่ให้สัญญาณการซื้อขายที่ถูกต้อง รวดเร็ว และแม่นยำมากที่สุด	59
บทที่ 5 สรุปผลการศึกษาและข้อเสนอแนะ		
5.1	สรุปผลการศึกษา	62
5.1.1	การศึกษาเปรียบเทียบการส่งสัญญาณซื้อขายที่ได้จากการวิเคราะห์ ทางเทคนิคกับการเคลื่อนไหวของราคาหลักทรัพย์จริง	63

ญ

5.1.2 การศึกษาเปรียบเทียบผลตอบแทนที่ได้จากการลงทุนในหลักทรัพย์ โดยการใช้สัญญาณซื้อขายจากเครื่องมือวิเคราะห์หลักทรัพย์ทางเทคนิค	66
5.1.3 การศึกษาเปรียบเทียบหาเครื่องมือในการวิเคราะห์หลักทรัพย์ที่ต้อง รวดเร็ว และแม่นยำมากที่สุด	66
5.2 ข้อเสนอแนะ	68
เอกสารอ้างอิง	70
ประวัติผู้เขียน	72

สารบัญตาราง

ตาราง		หน้า
1	สัดส่วนความถูกต้องของสัญญาณซื้อขายจากเครื่องมือ เส้นดัชนีกำลังสัมพัทธ์	31
2	สัดส่วนความถูกต้องของสัญญาณซื้อขายจากเครื่องมือ เส้นค่าเฉลี่ยเคลื่อนที่สองเส้น	34
3	สัดส่วนความถูกต้องของสัญญาณซื้อขายจากเครื่องมือ เส้นสโตแคสติกส์แบบช้า	38
4	สัดส่วนความถูกต้องของสัญญาณซื้อขายจากเครื่องมือ เส้นสโตแคสติกส์แบบเร็ว	41
5	สัดส่วนความถูกต้องของสัญญาณซื้อขายจากเครื่องมือ เส้นสโตแคสติกส์แบบปรับปรุง	45
6	สัดส่วนความถูกต้องของสัญญาณซื้อขายจากเครื่องมือวิเคราะห์ หลักทรัพย์ทางเทคนิคกับสัดส่วนความถูกต้องที่เกิดจากการสุ่ม	48
7	ความถูกต้อง แม่นยำ และรวดเร็ว จากเครื่องมือวิเคราะห์หลักทรัพย์ทางเทคนิค	59

สารบัญภาพ

รูป		หน้า
1	เส้นเครื่องมือเส้นค่าเฉลี่ยเคลื่อนที่สองเส้น	20
2	เส้นเครื่องมือเส้นดัชนีกำลังสัมพัทธ์	22
3	เส้นเครื่องมือเส้นสโตแคสติกส์แบบเร็ว	24
4	เส้นเครื่องมือเส้นสโตแคสติกส์แบบช้า	24
5	เส้นเครื่องมือเส้นสโตแคสติกส์แบบปรับปรุง	25
6	ผลตอบแทนในหลักทรัพย์จากการใช้เครื่องมือเส้นดัชนีกำลังสัมพัทธ์	51
7	ผลตอบแทนในหลักทรัพย์จากการใช้เครื่องมือเส้นค่าเฉลี่ยเคลื่อนที่สองเส้น	52
8	ผลตอบแทนในหลักทรัพย์จากการใช้เครื่องมือเส้นสโตแคสติกส์แบบช้า	53
9	ผลตอบแทนในหลักทรัพย์จากการใช้เครื่องมือเส้นสโตแคสติกส์แบบเร็ว	54
10	ผลตอบแทนในหลักทรัพย์จากการใช้เครื่องมือเส้นสโตแคสติกส์แบบปรับปรุง	56
11	ผลตอบแทนในหลักทรัพย์จากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์หลักทรัพย์ทางเทคนิค ทั้ง 5 เครื่องมือ	57