

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ก
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ณ
สารบัญภาพ	ญ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญ	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	2
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับการศึกษา	2
1.4 ขอบเขตการศึกษา	2
บทที่ 2 แนวคิด ทฤษฎี และผลงานการศึกษาที่เกี่ยวข้อง	
2.1 แนวคิดและทฤษฎี	3
2.1.1 การวิเคราะห์อนุกรมเวลา	3
2.1.2 การทดสอบยูนิทรูท	3
2.1.3 Dickey-Fuller Test with GLS Detrending (DFGLS)	4
2.1.4 เทคนิคการวิเคราะห์พฤติกรรมความเสี่ยงหลักทรัพย์โดยวิธีมอนติคาโล	6
2.2 สรุปสาระสำคัญจากเอกสารที่เกี่ยวข้อง	21

บทที่ 3 ระเบียบวิธีการวิจัย	
3.1 แบบจำลองที่ใช้ในการวิจัย	22
3.2 วิธีการวิเคราะห์ข้อมูล	25
บทที่ 4 ผลการศึกษา	
4.1 ลักษณะการเคลื่อนไหวของราคาหลักทรัพย์	26
4.2 การทดสอบความน่าเชื่อถือของข้อมูลโยวิธีการยูนิตรูท	30
4.3 การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์โดยวิธีมอนติคาโล	34
บทที่ 5 บทสรุปและข้อเสนอแนะ	
5.1 บทสรุป	37
5.1.1 การทดสอบยูนิตรูท	37
5.1.2 การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มอุตสาหกรรมอาหาร ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีมอนติคาโล	38
5.2 ข้อเสนอแนะ	41
เอกสารอ้างอิง	42
ภาคผนวก	44
ภาคผนวก ก ผลการทดสอบยูนิตรูท	45
ภาคผนวก ข ข้อมูลพื้นฐานบริษัท	57
ประวัติผู้เขียน	63

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบัญตาราง

ตาราง		หน้า
4.1	ผลการทดสอบ Unit Root ที่ระดับ Level : กรณีหุ้นของบริษัท เชียงใหม่โฟร เช่นฟู๊ดส์ จำกัด(มหาชน)	30
4.2	ผลการทดสอบ Unit Root ที่ระดับ Level : กรณีหุ้นของบริษัท ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน)	30
4.3	ผลการทดสอบ Unit Root ที่ระดับ Level : กรณีหุ้นของบริษัท โออิชิ กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)	31
4.4	ผลการทดสอบ Unit Root ที่ระดับ Level : กรณีหุ้นของบริษัท เพรซิเดนทึ่ เบเกอร์ จำกัด (มหาชน)	32
4.5	ผลการทดสอบ Unit Root ที่ระดับ Level : กรณีหุ้นของบริษัท เอส แอนด์ พี ซินดิเคท จำกัด (มหาชน)	32
4.6	ผลการทดสอบ Unit Root ที่ระดับ Level : กรณีหุ้นของบริษัท ยูนิวานิช น้ำมันปาล์ม จำกัด (มหาชน)	33
4.7	ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ที่ระดับ α เท่ากับ 0.10	34
4.8	ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ที่ระดับ α เท่ากับ 0.05	35
4.9	ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ที่ระดับ α เท่ากับ 0.01	35

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

สารบัญภาพ

รูป		หน้า
4.1	ราคาหุ้นของบริษัท เชียงใหม่ไฟรเซ่นฟู้ดส์ จำกัด(มหาชน)	26
4.2	ราคาหุ้นของบริษัท ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน)	27
4.3	ราคาหุ้นของบริษัท โออิชิ กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)	27
4.4	ราคาหุ้นของบริษัท เพรซิเดนที เบเกอร์รี่ จำกัด (มหาชน)	28
4.5	ราคาหุ้นของบริษัท เอส แอนด์ พี ซินดิเคท จำกัด (มหาชน)	28
4.6	ราคาหุ้นของบริษัท ยูนิวานิชน้ำมันปาล์ม จำกัด (มหาชน)	29

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved