

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ญ
สารบัญภาพ	ฎ
สารบัญภาพภาคผนวก	ฏ
บทที่ 1 บทนำ	1
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	4
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา	4
1.4. ขอบเขตในการศึกษา	4
1.5 นิยามศัพท์	5
บทที่ 2 ทฤษฎี แนวคิด และผลงานการศึกษาที่เกี่ยวข้อง	8
2.1 ทฤษฎีและแนวคิด	8
1) ลักษณะของสัญญา Futures	8
2) การวางหลักประกัน	8
3) ตลาดซื้อขายล่วงหน้า (Future Market)	9
4) การวิเคราะห์ทางเทคนิค (Technical Analysis)	9
2.2 ผลงานการศึกษาที่เกี่ยวข้อง	17
บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย	20
3.1 ระเบียบวิธีการศึกษา	20
3.2 เครื่องมือทางเทคนิคที่ใช้ในการศึกษา	21

บทที่ 4 ผลการศึกษา	29
4.1 กรณีศึกษาที่ 1 เปิดสัญญาเพียงด้านเดียว	29
1) ยางแผ่นรมควันชั้น 3 (RSS3)	29
2) มันสำปะหลังเส้น (TC)	30
3) ข้าวขาว 5% แบบ Both Options (BWR5)	31
4) ข้าวหอมมะลิ 100 เปอร์เซนต์ ชั้น 2 Both Options (BHMR)	32
4.2 การศึกษากรณีที่ 2 การเปิดสัญญาเพื่อหวังส่วนต่างแบบคู่สเปรด	36
1) ยางแผ่นรมควันชั้น 3 (RSS3)	37
2) มันสำปะหลังเส้น (TC)	38
3) ข้าวขาว 5% แบบ Both Options (BWR5)	39
4) ข้าวหอมมะลิ 100 เปอร์เซนต์ ชั้น 2 Both Options (BHMR)	40
บทที่ 5 สรุปและข้อเสนอแนะ	
5.1 สรุปผลการศึกษา	41
5.2 ข้อจำกัดในการศึกษา	42
5.3 ข้อเสนอแนะ	43
เอกสารอ้างอิง	44
ภาคผนวก	46
ประวัติผู้เขียน	49

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
4.1 แสดงผลตอบแทนของการลงทุนในยางแผ่นรมควันชั้น 3 (RSS3)	29
4.2 แสดงผลตอบแทนของการลงทุนในมันสำปะหลังเส้น (TC)	30
4.3 แสดงผลตอบแทนของการลงทุนในข้าวขาว 5% แบบ Both Options (BWR5)	31
4.4 แสดงผลตอบแทนของการลงทุนในข้าวหอมมะลิ 100 เปอร์เซนต์ ชั้น 2 (Both Options (BHMR)	32
4.5 แสดงความแม่นยำของการลงทุนในยางแผ่นรมควันชั้น 3 (RSS3) โดยใช้เครื่องมือทางเทคนิค	33
4.6 แสดงความแม่นยำของการลงทุนในมันสำปะหลังเส้น (TC) โดยใช้เครื่องมือทางเทคนิค	34
4.7 แสดงความแม่นยำของการลงทุนในข้าวขาว 5% แบบ Both Options (BWR5) โดยใช้เครื่องมือทางเทคนิค	35
4.8 แสดงความแม่นยำของการลงทุนใน ข้าวหอมมะลิ 100 เปอร์เซนต์ ชั้น 2 (Both Options (BHMR) โดยใช้เครื่องมือทางเทคนิค	36
4.9 แสดงผลตอบแทนก่อนและหลังการทำสเปรดและแสดงค่าเบต้าของยางแผ่นรมควันชั้น 3 (RSS3)	37
4.10 แสดงผลตอบแทนก่อนและหลังการทำสเปรดและแสดงค่าเบต้า ของมันสำปะหลังเส้น (TC)	38
4.11 แสดงผลตอบแทนก่อนและหลังการทำสเปรดและแสดงค่าเบต้า ของข้าวขาว 5% แบบ Both Options (BWR5)	39
4.12 แสดงผลตอบแทนก่อนและหลังการทำสเปรดและแสดงค่าเบต้า ของข้าวหอมมะลิ 100 เปอร์เซนต์ ชั้น 2(Both Options (BHMR)	40

สารบัญภาพ

รูป	หน้า
1.1 ปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยและมูลค่าการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในปี 2547-2553	2
4.1 แสดงส่วนต่างของราคา sport และ future ของยางแผ่นรมควันชั้น 3 (RSS3)	37
4.2 แสดงส่วนต่างของราคา sport และ future ของมันล้าปะหลังเส้น (TC)	38
4.3 แสดงส่วนต่างของราคา sport และ future ของข้าวขาว 5% แบบ Both Options (BWR5)	39
4.4 แสดงส่วนต่างของราคา sport และ future ของข้าวหอมมะลิ 100 เปอร์เซ็นต์ ชั้น 2 (Both Options (BHMR))	40

สารบัญภาพภาคผนวก

รูปภาคผนวก		หน้า
1	รูปภาพแสดงกราฟราคาของยางแผ่นรมควันชั้น 3 โดยใช้ William%Rในการวิเคราะห์	47
2	รูปภาพแสดงกราฟราคาของมันสำปะหลังเส้น โดยใช้ EMA ในการวิเคราะห์	47
3	รูปภาพแสดงกราฟราคาของของข้าวหอมมะลิ โดยใช้ RSIในการวิเคราะห์	48
4	รูปภาพแสดงกราฟราคาของของข้าวขาว % โดยใช้ OBVในการวิเคราะห์	48