

## สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ญ
สารบัญภาพ	ฎ
<b>บทที่ 1 บทนำ</b>	<b>1</b>
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	5
1.3 ประโยชน์ที่ได้รับจากการศึกษา	5
1.4 นิยามศัพท์	5
<b>บทที่ 2 ทฤษฎี แนวคิด และงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง</b>	<b>8</b>
2.1 ทฤษฎีและแนวคิดที่ใช้ในการศึกษา	8
2.2 งานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	25
<b>บทที่ 3 ระเบียบและวิธีการศึกษา</b>	<b>28</b>
3.1 ข้อมูลการวิจัย	28
3.2 ประชากรของการวิจัย	29
3.3 การเลือกกลุ่มตัวอย่าง	29
3.4 การเก็บรวบรวมข้อมูล	29
3.5 วิธีการศึกษา	29
3.6 สถิติที่ใช้ในการวิจัยและแบบจำลอง	30

บทที่ 4 ผลการศึกษาและการวิเคราะห์ข้อมูล	33
4.1 ลักษณะทั่วไปของหุ้นในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย	33
4.2 การวิเคราะห์ตัวแปรที่มีผลต่อการเปลี่ยนแปลงของราคาหุ้น โดยใช้แบบจำลองโลจิสติก (Logistic Regression)	40
4.3 การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างตัวแปรที่มีผลต่อการเปลี่ยนแปลง ของราคาหุ้น	44
4.4 การวิเคราะห์การเปลี่ยนแปลงของราคาหุ้นในตลาดหลักทรัพย์ แห่งประเทศไทย โดยใช้แบบจำลองโลจิสติก (Logistic regression) และแบบจำลองโครงข่ายประสาทเทียม (Neuron network)	45
บทที่ 5 สรุปผลการศึกษา ข้อเสนอแนะ	47
5.1 สรุปผลการศึกษา	47
5.2 ข้อเสนอแนะ	49
เอกสารอ้างอิง	50
ภาคผนวก	52
ประวัติผู้เขียน	61

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
4.1 ลักษณะทั่วไปของหุ้นในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยตั้งแต่เดือนมกราคม พ.ศ. 2548 ถึง ธันวาคม พ.ศ. 2552	34
4.2 แสดงผลการวิเคราะห์ตัวแปรที่มีผลต่อการเปลี่ยนแปลงของราคาหุ้น โดยใช้แบบจำลองโลจิท (Logistic Regression)	40
4.3 แสดงผลการการศึกษารายละเอียดของตัวแปร	41
4.4 แสดงความสัมพันธ์ระหว่างตัวแปรที่มีผลต่อการเปลี่ยนแปลงของราคาหุ้น	44
4.5 แสดงการประเมินแบบจำลองโลจิทจากการทำนายความถูกต้อง โดยใช้วิธี Classification Agreement	45
4.6 แสดงการประเมินแบบจำลองโครงข่ายประสาทเทียมจากการทำนายความถูกต้อง โดยใช้วิธี Classification Agreement	45

## สารบัญภาพ

รูป	หน้า
1.1 แสดงความเสี่ยงที่เป็นระบบและความเสี่ยงที่ไม่เป็นระบบ	2
2.1 ชั้นตอนต่าง ๆ ของกระบวนการ KDD	8
2.2 แบบจำลองนิเวรอนเทียมตัวแรก โดย Warren Mcculloch และ Walter Pitt	14
2.3 ไดอะแกรมของกระบวนการ Classification Neural Network	15
2.4 การกระจายแบบลอจิสติกส์และการกระจายแบบปกติมาตรฐาน	21
2.5 แสดงภาพแนวโน้มราคาหุ้นขาขึ้นแบบ uptrend	24
2.6 แสดงภาพแนวโน้มราคาหุ้นขาลงแบบ downtrend	25