



ความสัมพันธ์ระหว่าง Google Trends กับ ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ และการใช้ Google Trends เป็นสัญญาณทางเทคนิค



Google Search

I'm Feeling Lucky

Google offered in: ภาษาไทย



- ที่มาและความสำคัญ
- การใช้อินเทอร์เน็ตในประเทศไทย
- ตลาดหุ้นวันนี้
- นักลงทุน
- SET50

Report inappropriate predictions

วัตถุประสงค์

เพื่อศึกษาว่าคำค้นหาใดในช่วงเวลาที่ผ่านมา มีความสัมพันธ์และเป็นสาเหตุต่อดัชนีตลาดหลักทรัพย์ SET50 และการสร้างกลยุทธ์การลงทุนด้วยสัญญาณจากดัชนีปริมาณการค้นหา (Search volume index)

ข้อมูลที่ใช้

- ช่วงเวลาศึกษา 3 ม.ค. 61 – 27 ธ.ค. 62
- คำค้นหาจาก Google Trends 83 คำ
- ผลตอบแทน SET50 จาก SET SMART

วิธีการศึกษา

- แบบจำลอง
- Vector autoregressive
- Granger causality
- การใช้ Search volume index เป็นสัญญาณซื้อขาย

ผลการศึกษา

- จากแบบจำลอง Vector autoregressive
 - พบว่ามีคำค้นหาที่มีความสัมพันธ์ 16 คำ จาก 83 คำ
- จากแบบจำลอง Granger causality
 - พบว่ามีคำค้นหาที่เป็นสาเหตุต่อการเปลี่ยนแปลงของผลตอบแทน SET50 16 คำ

การใช้ Search volume index เป็นสัญญาณซื้อขาย

- พบว่าการใช้ Search volume index เป็นสัญญาณสามารถสร้างผลกำไรในการลงทุนได้
- คำค้นหาที่ให้ผลตอบแทนสูง
 - พบว่ามีคำค้นหาที่ให้ผลตอบแทนสูงเป็นคำค้นหาที่ผู้ค้นหามีการเจาะจงรายละเอียดในการค้นหา

