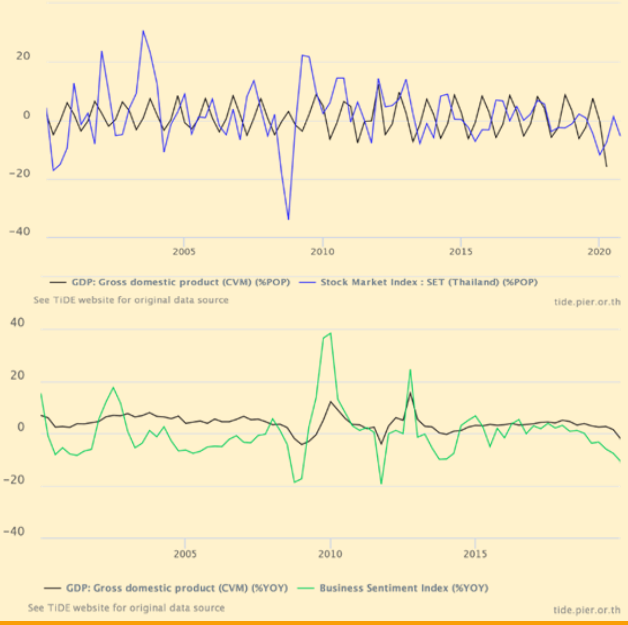


ดัชนีความเชื่อมั่นทางธุรกิจที่ส่งผลกระทบต่อดัชนีราคายอดอุตสาหกรรมในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ที่มาและความสำคัญ



- GDP ส่งผลการทำกำไรของบริษัทที่จะจดทะเบียนใน SET
- GDP มีแนวโน้มดีขึ้น ราคาหุ้นสูงขึ้น
- BSI สะท้อนภาวะธุรกิจและเศรษฐกิจโดยรวมได้

[วัตถุประสงค์]

- BSI มีผลอย่างไรต่อ SET index รายอุตสาหกรรม
- BSI สะท้อนผลได้ดีในอุตสาหกรรมและใช้เวลาเท่าไรเพื่อปรับตัวเข้าสู่ดุลยภาพเดิม

หมายเหตุ GDP คือ ผลิตภัณฑ์มวลรวมของประเทศ, SET คือ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย, BSI คือ ดัชนีความเชื่อมั่นทางธุรกิจ

วิธีการศึกษา

1. ทดสอบ Unit root
2. หา Lag length
3. หาความสัมพันธ์ระยะยาว (Cointegration) โดยใช้ค่า Residual
4. ทดสอบการปรับตัวระยะสั้น (Error-Correction)

สรุปการศึกษา

BSI มีความสัมพันธ์ระยะยาวต่อทั้ง 8 อุตสาหกรรมในทิศทางเดียวกัน โดยอุตสาหกรรมเกษตรและอาหารได้รับผลกระทบมากที่สุดที่ 23.10337 จุด ขณะที่กลุ่มสินค้าอุตสาหกรรมกลับสู่ดุลยภาพเดิมได้เร็วที่สุดที่ร้อยละ 8.08 ดังนั้น จากการศึกษาครั้งนี้สะท้อนให้เห็น BSI ส่งผลกระทบต่อดัชนีราคาทุกอุตสาหกรรมในตลาดหลักทรัพย์ นักลงทุนจึงสามารถใช้ BSI เป็นเครื่องมือคาดการณ์สภาวะตลาดของดัชนีราคายอดอุตสาหกรรมเพื่อการวางกลยุทธ์และเพิ่มประสิทธิภาพการลงทุนให้ดียิ่งขึ้น

[ข้อเสนอแนะ]



Passive



Active