

การศึกษาอิทธิพลของวันในสัปดาห์ที่มีต่อหุ่นย้อยยืนในตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ

ปาริตา ทองขาว

โครงงานสถิตินี้เป็นส่วนหนึ่งของการศึกษาตามหลักสูตรวิทยาศาสตรบัณฑิต

สาขาวิชาสถิติ ปีการศึกษา 2560

ภาควิชาคณิตศาสตร์ คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยบูรพา

ชื่อเรื่อง

การศึกษาอิทธิพลของวันในสัปดาห์ที่มีต่อหุ้นยั่งยืนในตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ

THE STUDY OF DAY-OF-THE-WEEK-EFFECT RETURN OF MAI IN THAILAND SUSTAINABILITY INVESTMENT

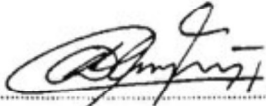
ชื่อนิสิต ปาริตา ทองขาว

รหัสประจำตัวนิสิต 57030505

อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก ดร. อภิศักดิ์ ไชยโรจน์วัฒนา


โครงการงานสถิตินี้เป็นส่วนหนึ่งของการศึกษาตามหลักสูตรวิทยาศาสตรบัณฑิต สาขาวิชาสถิติ
ปีการศึกษา 2560

คณะกรรมการควบคุมโครงการงานสถิติ


.....อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก
(ดร.อภิศักดิ์ ไชยโรจน์วัฒนา)


คณะกรรมการสอบโครงการงานสถิติ


.....ประธานกรรมการ
(ดร.วินดา พงษ์ศักดิ์ชาติ)


.....กรรมการ
(ดร.บำรุงศักดิ์ เฟื้ออารีย์)


.....กรรมการ
(ดร.อภิศักดิ์ ไชยโรจน์วัฒนา)

คณะกรรมการสอบโครงการงานสถิตินุมัติให้โครงการงานสถิติฉบับนี้เป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรวิทยาศาสตรบัณฑิต สาขาวิชาสถิติ ของมหาวิทยาลัยบูรพา


.....ประธานหลักสูตรวิทยาศาสตรบัณฑิต
สาขาวิชาสถิติ

(ผู้ช่วยศาสตราจารย์ปริยรัตน์ นาคสุวรรณ)

วันที่ ๕ เดือน พฤษภาคม พ.ศ. ๒๕๖๑

ประกาศคุณูปการ

โครงการสัณติฉบับนี้สำเร็จลุล่วงไปด้วยความกรุณาอย่างสูงจาก ดร.อภิศักดิ์ ไชยโรจน์วัฒนา อาจารย์ที่ปรึกษา ซึ่งท่านได้ให้คำปรึกษาและคำแนะนำที่ดี ตลอดจนช่วยตรวจสอบแก้ไข ปรับปรุงข้อบกพร่องต่างๆ จนกระทั่งโครงการเสร็จสมบูรณ์ ผู้ศึกษาจึงขอกราบขอบพระคุณมาอย่างสูง ณ โอกาสนี้

นอกจากนี้ผู้ศึกษาขอขอบคุณ อาจารย์ นพรัตน์ แป้นงาม ดร.วนิดา พงษ์ศักดิ์ชาติ และ ดร.บำรุงศักดิ์ เพื่อนอารีย์ ที่ได้เสียสละเวลา ในการให้คำแนะนำเพิ่มเติมในการปรับปรุงแก้ไขโครงการสัณติฉบับนี้ให้ถูกต้อง และเสร็จสมบูรณ์ยิ่งขึ้น ผู้ศึกษาจึงกราบขอบพระคุณมาอย่างสูงไว้ ณ ที่นี้

สุดท้ายนี้ขอกราบขอบพระคุณบิดา มารดา ที่อยู่เบื้องหลังในความสำเร็จ ซึ่งได้ให้ความช่วยเหลือ สนับสนุนและให้กำลังใจ ตลอดมาและขอบคุณเพื่อน ๆ ที่เป็นกำลังใจในการทำโครงการสัณติจนสำเร็จลุล่วงไปด้วยดี

ปาริตา ทองขาว

57030505: สาขาวิชา: สถิติ; วท.บ. (สถิติ)

คำสำคัญ: อิทธิพลของวันในสัปดาห์ / อัตราผลตอบแทน / หุ้นยั่งยืน

ปาริตา ทองขาว: การศึกษาอิทธิพลของวันในสัปดาห์ที่มีต่อหุ้นยั่งยืนในตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (THE STUDY OF DAY-OF-THE-WEEK-EFFECT RETURNS. OF MAI IN THAILAND SUSTAINABILITY INVESTMENT)

คณะกรรมการควบคุมโครงการ: อภิศักดิ์ ไชยโรจน์วัฒนา, Ph.D. 35 หน้า. ปีการศึกษา 2560.

บทคัดย่อ

วัตถุประสงค์ของการวิจัยในครั้งนี้เพื่อศึกษาอิทธิพลของวันในสัปดาห์ที่มีต่อผลตอบแทนของหุ้นยั่งยืนปี 2560 ในตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ ซึ่งประกอบด้วยหุ้นของ 7 บริษัท ได้แก่ AKP CHO GCAP FPI PPS TVD และ UAC การวิจัยครั้งนี้ได้ใช้อัตราผลตอบแทนของทั้ง 7 หุ้น ตั้งแต่วันที่ 23 พฤษภาคม พ.ศ. 2557 ถึง 31 สิงหาคม พ.ศ. 2560 โดยทำการวิเคราะห์ลักษณะเบื้องต้นของข้อมูลโดยการหาสถิติพรรณนา ได้แก่ ค่าเฉลี่ย มัธยฐาน ส่วนเบี่ยงเบนมาตรฐาน ค่าต่ำสุด และค่าสูงสุด หลังจากนั้นได้ทำการทดสอบว่าอัตราผลตอบแทนเฉลี่ยในวันต่าง ๆ ของหุ้นแต่ละตัวมีความแตกต่างกันหรือไม่โดยการวิเคราะห์ความแปรปรวน และได้ทำการตรวจสอบข้อตกลงเบื้องต้นของการทดสอบความแปรปรวน พบว่าหุ้นทั้ง 7 หุ้นที่นำมาศึกษามีการแจกแจงข้อมูลที่ไม่ใช่การแจกแจงปกติ ซึ่งไม่เป็นไปตามข้อตกลงเบื้องต้นของการวิเคราะห์ความแปรปรวน ดังนั้นผู้วิจัยจึงใช้การวิเคราะห์ข้อมูลด้วยการทดสอบ Kruskal-Wallis และทำการเปรียบเทียบเชิงซ้อนต่อไป โดยการศึกษาครั้งนี้พบว่า อัตราผลตอบแทนของหุ้น AKP GCAP FPI PPS และ TVD ไม่ปรากฏอิทธิพลของวันในสัปดาห์ แต่สำหรับหุ้น CHO และ หุ้น UAC ปรากฏอิทธิพลของวันในสัปดาห์ โดยในหุ้น CHO พบว่าวันจันทร์เป็นวันที่มีอัตราผลตอบแทนแตกต่างจากวันพุธ และหุ้น UAC พบว่าวันอังคารเป็นวันที่มีอัตราผลตอบแทนแตกต่างจากวันพุธ และวันศุกร์

57030505: MAJOR: STATISTICS; B.Sc. (STATISTICS)

KEYWORDS: DAY-OF-THE-WEEK-EFFECT/ RETURN/ THAILAND SUSTAINABILITY INVESTMENT

PARITA THONGKHAO: THE STUDY OF DAY-OF-THE-WEEK-EFFECT RETURNS OF
MAI IN THAILAND SUSTAINABILITY INVESTMENT

ADVISOR: APISAK CHIROJWATTANA, Ph.D. 35 P. ACADEMIC YEARS 2017.

ABSTRACT

The objective of this research is to study the effect of the day in a week on the return of sustainability investment, which consists of 7 companies; AKP, CHO, GCAP, FPI, PPS, TVD and UAC, of year 2017 in the Market for Alternative Investment (mai). This study use yield of all 7 stocks from 23rd, May 2014 to 31st, August 2017. The data are analyzed by means of descriptive statistics; mean, median, standard deviation, minimum value and maximum value. Then the ANOVA is applied to test the mean different of return in each day for all 7 stocks. In this study, the assumption of ANOVA is examined and we find that for all 7 stocks, assumptions are violated, i.e. non-normal distribution. Therefore, the Kruskal-Wallis test and comparison test are applied. The results are found that there is no influence of the day in the week on the return of AKP, GCAP, FPI, PPS and TVD. But for CHO and UAC, there is effect of the day in the week. We also found that the return of Monday is different from that of Wednesday for CHO and for UAC shares; we found that the return of Tuesday is different from that of Wednesday and Friday.