

หัวข้อการค้นคว้าอิสระ	ผลกระทบของสงครามการค้าระหว่างสหรัฐอเมริกา กับจีนต่อดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET INDEX)
ชื่อผู้เขียน	นายปณชัย กฤตธนชัย
ชื่อปริญญา	วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต
สาขาวิชา/คณะ/มหาวิทยาลัย	การบัญชีและบริหารการเงิน คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
อาจารย์ที่ปรึกษาการค้นคว้าอิสระ	รองศาสตราจารย์ ดร.สมชาย สุภัทรกุล
ปีการศึกษา	2562

บทคัดย่อ

งานวิจัยนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อศึกษาผลกระทบของเหตุการณ์สงครามการค้าระหว่างสหรัฐอเมริกากับจีนต่อผลตอบแทนของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยในช่วงปี 2561 – 2562 ซึ่งเป็นช่วงเวลาที่เกิดสงครามการค้าขึ้นเป็นระยะเวลากว่า 2 ปี

จากผลการศึกษาสรุปได้ว่า เหตุการณ์ที่เป็นการขึ้นภาษี การโต้ตอบกันทางการค้าระหว่างสหรัฐฯ กับจีน พบผลตอบแทนต่ำกว่าปกติอย่างมีนัยสำคัญ โดยมี 2 เหตุการณ์ ได้แก่ เหตุการณ์วันที่ 13 พฤษภาคม 2019 และเหตุการณ์วันที่ 1 สิงหาคม 2019 พบผลตอบแทนต่ำกว่าปกติอย่างมีนัยสำคัญทั้งวันที่เกิดเหตุการณ์, วันหลังวันที่เกิดเหตุการณ์ 1 วัน, วันหลังวันที่เกิดเหตุการณ์ 2 วัน แสดงว่าเหตุการณ์เหล่านี้ส่งผลกระทบต่ออย่างต่อเนืองต่อดัชนี ส่วนเหตุการณ์ที่เป็น การเจรจา ข้อตกลงทางการค้า เหตุการณ์ยกเลิกการขึ้นภาษี พบผลตอบแทนเกินปกติอย่างมีนัยสำคัญหลังวันที่เกิดเหตุการณ์ 1 วัน ในเหตุการณ์วันที่ 10 ตุลาคม 2019

คำสำคัญ: สงครามการค้า, สหรัฐฯ, จีน, อัตราผลตอบแทนเกินปกติ, Event Study