

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ญ
สารบัญภาพ	ฎ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	3
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา	3
1.4 ขอบเขตของการศึกษา	3
1.5 นิยามศัพท์	4
บทที่ 2 กรอบแนวคิดทางทฤษฎีและเอกสารที่เกี่ยวข้อง	
2.1 กรอบแนวคิดทางทฤษฎี	6
2.2 เอกสารที่เกี่ยวข้อง	10
บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย	
3.1 วิธีการวิจัย	13
3.2 การคำนวณค่าตัวแปรที่ใช้ในศึกษา	17
บทที่ 4 ผลการศึกษาและการวิเคราะห์ข้อมูล	
4.1 ผลการทดสอบ Unit Root	20
4.2 การหาค่าความเสี่ยง	22
4.3 การประเมินมูลค่าของกองทุน	25

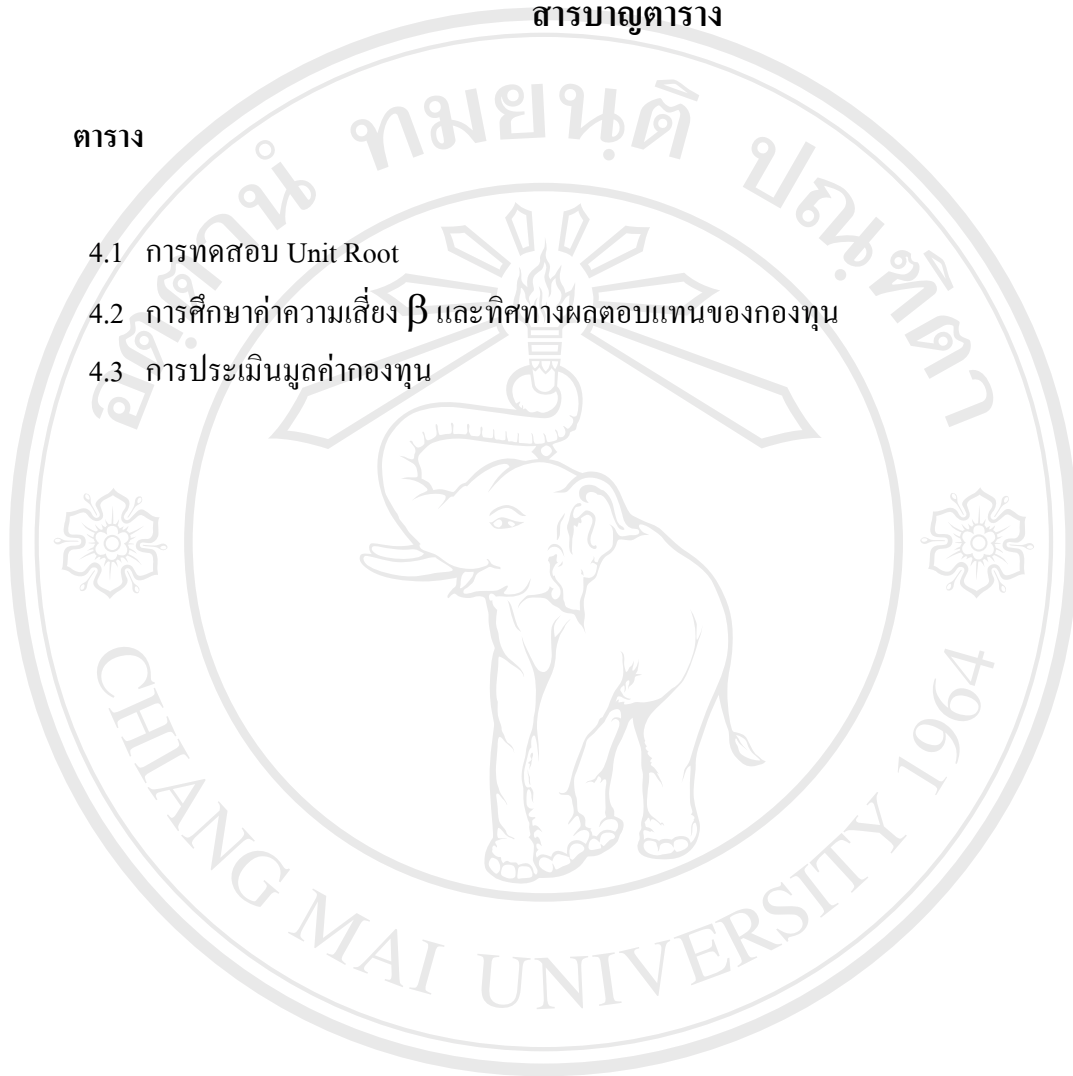
บทที่ 5 บทสรุปและข้อเสนอแนะ	
5.1 สรุปผลการศึกษา	29
5.2 ข้อเสนอแนะ	30
เอกสารอ้างอิง	31
ภาคผนวก	
ภาคผนวก ก ผลการทดสอบ Unit Root ของข้อมูล	34
ภาคผนวก ข ผลการวิเคราะห์การถดถอยอย่างง่ายโดยวิธี Capital Asset Pricing Model (CAPM)	86
ประวัติผู้เขียน	95

สารบัญตาราง

ตาราง

หน้า

- | | |
|--|----|
| 4.1 การทดสอบ Unit Root | 20 |
| 4.2 การศึกษาค่าความเสี่ยง β และทิศทางผลตอบแทนของกองทุน | 23 |
| 4.3 การประเมินมูลค่ากองทุน | 26 |



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบัญภาพ

รูป

หน้า

2.1 ความสัมพันธ์ระหว่างผลตอบแทนที่คาดหวังกับความเสี่ยงในการลงทุนในหลักทรัพย์

9



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved