

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ณ
สารบัญภาพ	ฐ
บทที่ 1 บทนำ	1
1.1 ความเป็นมาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	5
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ	6
1.4 ขอบเขตของการศึกษา	6
บทที่ 2 ผลงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	7
บทที่ 3 กรอบทฤษฎี และระเบียบวิธีวิจัย	11
3.1 ทฤษฎีความสมดุลของกองทุนทรัพย์สิน	11
3.2 ระเบียบวิธีวิจัย	17
บทที่ 4 ผลการศึกษา	29
4.1 ผลการศึกษาที่ได้จากการวิเคราะห์ทางเทคนิคและ การตัดสินใจลงทุนภายใต้ความเสี่ยง	29
4.2 ผลการศึกษาที่ได้การจัดลำดับประสิทธิภาพของ เครื่องมือการวิเคราะห์ทางเทคนิค	92
บทที่ 5 บทสรุป	102
5.1 สรุปผลการศึกษาการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิค	102
5.2 ข้อจำกัดของการศึกษา	103
5.3 ข้อเสนอแนะสำหรับแนวทางการศึกษาครั้งต่อไป	104
บรรณานุกรม	105
ประวัติผู้เขียน	107

สารบัญตาราง

ตาราง		หน้า
1.1	กลุ่มอุตสาหกรรมที่หลักทรัพย์มีการซื้อขายสูงสุด 20 อันดับ	2
1.2	ผลการจัดอันดับหลักทรัพย์ที่ให้ผลตอบแทนในกลุ่มธุรกิจการเกษตร	3
4.1	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ ห้องเย็น เอเชียัน ซีฟูต (ASIAN)	30
4.2	แสดงผลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของ หลักทรัพย์ ห้องเย็นเอเชียัน ซีฟูต (ASIAN)	32
4.3	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ ซีเฟรสดินด์สตรี (ไทยแลนด์) (CFRESH)	33
4.4	แสดงผลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลัก ทรัพย์ซีเฟรสดินด์สตรี (ไทยแลนด์) (CFRESH)	35
4.5	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ ห้องเย็นโชติ วัฒน์หาดใหญ่ (CHOTI)	36
4.6	แสดงผลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลัก ทรัพย์ห้องเย็นโชติวัฒน์หาดใหญ่ (CHOTI)	38
4.7	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ เชียงใหม่ โพรเซนฟูตส์ (CM)	39
4.8	แสดงผลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลัก ทรัพย์เชียงใหม่โพรเซนฟูตส์ (CM)	41
4.9	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ เจริญโภค ภัณฑ์อาหาร (CPF)	42
4.10	แสดงผลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลัก ทรัพย์ เจริญโภคภัณฑ์อาหาร (CPF)	44

ญ

4.11	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ ซุมพรอุตสาหกรรมน้ำมันปาล์ม (CPI)	45
4.12	แสดงมูลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลัก ทรัพย์ ซุมพรอุตสาหกรรมน้ำมันปาล์ม (CPI)	47
4.13	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ พันธุ์สุกร ไทย-เดนมาร์ค (D-MARK)	48
4.14	แสดงมูลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลัก ทรัพย์ พันธุ์สุกรไทย-เดนมาร์ค (D-MARK)	50
4.15	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ จีเอฟพีที (GFPT)	51
4.16	แสดงมูลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของ หลักทรัพย์ จีเอฟพีที (GFPT)	53
4.17	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ สีสพัฒนา ผลิตภัณฑ์ (LEE)	54
4.18	แสดงมูลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของ หลักทรัพย์ สีสพัฒนาผลิตภัณฑ์ (LEE)	56
4.19	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ แพ็คฟู้ด (PPC)	57
4.20	แสดงมูลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของ หลักทรัพย์ แพ็คฟู้ด (PPC)	59
4.21	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ ปทุมไรชมิล แอนด์ แกรนารี (PRG)	60
4.22	แสดงมูลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของ หลักทรัพย์ ปทุมไรชมิล แอนด์ แกรนารี (PRG)	62
4.23	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ ซีฮอर्स (SH)	63
4.24	แสดงมูลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของ หลักทรัพย์ ซีฮอर्स (SH)	65

4.25	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ ศรีไทยฟู้ด แอนด์ เบฟเวอเรจ (SRI)	66
4.26	แสดงมูลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ ศรีไทยฟู้ด แอนด์ เบฟเวอเรจ (SRI)	68
4.27	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ สุรพลฟู้ดส์ (SSF)	69
4.28	แสดงมูลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ สุรพลฟู้ดส์ (SSF)	71
4.29	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ ศรีตรังแอโกรอินดัสทรี (STA)	72
4.30	แสดงมูลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ ศรีตรังแอโกรอินดัสทรี (STA)	74
4.31	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ ไทยลักซ์ เอ็นเตอร์ไพรส์ (T-LUXE)	75
4.32	แสดงมูลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ ไทยลักซ์ เอ็นเตอร์ไพรส์ (T-LUXE)	77
4.33	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ ไทยอกริฟู้ดส์ (TAF)	78
4.34	แสดงมูลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ ไทยอกริ ฟู้ดส์ (TAF)	80
4.35	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ ตรังผลิตภัณฑ์อาหารทะเล (TRS)	81
4.36	แสดงมูลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ ตรังผลิตภัณฑ์อาหารทะเล (TRS)	83
4.37	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ ไทยรับเบอร์ลาเทคส์ (TRUBB)	84
4.38	แสดงมูลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ ไทยรับเบอร์ลาเทคส์ (TRUBB)	86

4.39	ผลตอบแทนที่ได้จากการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ สหอุตสาหกรรมน้ำมันปาล์ม (UPOIC)	87
4.40	แสดงมูลค่าคาดหวังที่จะได้รับจากการใช้เครื่องมือวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์ สหอุตสาหกรรมน้ำมันปาล์ม (UPOIC)	89
4.41	แสดงค่าเฉลี่ยของผลตอบแทนในรูปแบบต่างๆ ที่ได้จากหลักทรัพย์ทั้ง 20 หลักทรัพย์	90
4.42	แสดงจำนวนครั้งในการจัดอันดับของเครื่องมือการวิเคราะห์ทางเทคนิคในรูปแบบของผลตอบแทน	93
4.43	แสดงผลลัพธ์ที่ได้จากการควบแน่นน้ำหนักกับจำนวนครั้งในแต่ละอันดับของแต่ละเทคนิคในรูปแบบของผลตอบแทน	94
4.44	แสดงจำนวนครั้งในการจัดอันดับของเครื่องมือการวิเคราะห์ทางเทคนิคในรูปแบบของอัตราผลตอบแทนเฉลี่ยต่อปี	95
4.45	แสดงผลลัพธ์ที่ได้จากการควบแน่นน้ำหนักกับจำนวนครั้งในแต่ละอันดับของแต่ละเทคนิคในรูปแบบของอัตราผลตอบแทนเฉลี่ยต่อปี	96
4.46	แสดงจำนวนครั้งในการจัดอันดับของเครื่องมือการวิเคราะห์ทางเทคนิคในรูปแบบของผลตอบแทนอัตราผลตอบแทนเฉลี่ยต่อครั้ง	97
4.47	แสดงผลลัพธ์ที่ได้จากการควบแน่นน้ำหนักกับจำนวนครั้งในแต่ละอันดับของแต่ละเทคนิคในรูปแบบของอัตราผลตอบแทนเฉลี่ยต่อครั้ง	98
4.48	แสดงจำนวนครั้งของการจัดอันดับของเครื่องมือการวิเคราะห์ทางเทคนิคในรูปแบบของมูลค่าคาดหวังที่คาดว่าจะได้รับจากการลงทุน 10,000 บาท	99
4.49	แสดงผลลัพธ์ที่ได้จากการควบแน่นน้ำหนักกับจำนวนครั้งในแต่ละอันดับของแต่ละเทคนิคในรูปแบบของมูลค่าคาดหวังที่คาดว่าจะได้รับจากการลงทุน 10,000 บาท	100

สารบัญภาพ

รูป		หน้า
3.1	แสดงสมดุลของกองทุนทรัพย์สิน	13
3.2	การแจกแจงแบบจำนวนเต็ม	15
3.3	การแจกแจงแบบต่อเนื่อง	15
3.4	แสดงความเสี่ยงของการลงทุน	16

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright© by Chiang Mai University
 All rights reserved