

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ญ
บทที่ 1 บทนำ	1
1.1 ที่มาและความสำคัญของการศึกษา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	5
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา	5
1.4 ขอบเขตของการศึกษา	5
1.5 แหล่งที่มาของข้อมูล	6
1.6 นิยามศัพท์	6
บทที่ 2 ระบบอัตราแลกเปลี่ยนของไทย	8
2.1 วิวัฒนาการระบบอัตราแลกเปลี่ยนของไทย	8
2.2 บทบาทและผลกระทบทางเศรษฐกิจของระบบอัตราแลกเปลี่ยน	9
2.3 การบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	14
บทที่ 3 ทฤษฎี แนวความคิด และผลงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	16
3.1 อัตราผลตอบแทนที่คาดหวังและส่วนเบี่ยงเบนมาตรฐาน	16
3.2 โปรแกรมเชิงเส้น	18
3.3 แบบจำลองของ Markowitz	22
3.4 ผลงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	24
บทที่ 4 ระเบียบวิธีการศึกษา	28
4.1 ข้อมูลและแหล่งข้อมูล	28
4.2 วิธีการเก็บรวบรวมข้อมูล	28
4.3 การวิเคราะห์ข้อมูล	28
บทที่ 5 วิธีการศึกษาและผลการศึกษา	31
5.1 วิธีการศึกษา	31

5.2 ผลการศึกษา	35
บทที่ 6 สรูลผลการศึกษาและข้อเสนอแนะ	85
6.1 สรูลผลการศึกษา	85
6.2 ข้อเสนอแนะ	86
บรรณานุกรม	87
ภาคผนวก	89
ภาคผนวก ก ข้อมูลและผลการวิเคราะห์ข้อมูลโดยใช้โปรแกรมเชิงเส้นตรง ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	90
ประวัติผู้เขียน	181

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
1 แสดงอัตราแลกเปลี่ยนสกุลเงินตรงต่างประเทศ ณ ปี พ.ศ. 2540-2545	2
2 แสดงอัตราดอกเบี้ยเงินฝากสำหรับลูกค้าธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) ณ วันที่ 22 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2545	3
3 แสดงอัตรา ซื้อ - ขาย แลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของธนาคารพาณิชย์ตั้งแต่เดือนมกราคม - ธันวาคม พ.ศ. 2544	37
4 แสดงส่วนต่างของอัตราซื้อ-ขายเงินตราต่างประเทศ 8 สกุลที่ได้จากการคำนวณข้อมูลจากตารางที่ 3	38
5 แสดงค่าส่วนเบี่ยงเบนมาตรฐานของอัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในสกุลเงินตราต่างประเทศที่ได้จากการคำนวณข้อมูลตารางที่ 4	39
6 อัตราความเสี่ยงและสัดส่วนการลงทุนในสกุลเงินตราต่างประเทศอย่างเหมาะสมที่กำหนด 18 ช่วงเวลา	77
7 แสดงผลการวิเคราะห์ความไหวตัวของการเปลี่ยนแปลงต่าง ๆ ที่เป็นไปได้โดยสามารถทำให้ค่าความเสี่ยงที่เหมาะสมของสมการเป้าหมาย เปลี่ยนแปลงไปในทิศทางที่ดีขึ้น ในช่วงระยะเวลา 18 ช่วง	80
8 แสดงรายรับจากการลงทุนในสกุลเงินตราต่างประเทศของสถาบันการเงินท้องถิ่นแห่งหนึ่งในเขตอำเภอเมือง จังหวัดเชียงใหม่ ตั้งแต่เดือนมกราคม พ.ศ. 2543 ถึงเดือนธันวาคม พ.ศ. 2543	81
9 แสดงรายรับจากการลงทุนในสกุลเงินตราต่างประเทศของสถาบันการเงินท้องถิ่นแห่งหนึ่งในเขตอำเภอเมือง จังหวัดเชียงใหม่ ตั้งแต่เดือนมกราคม พ.ศ. 2544 ถึงเดือนธันวาคม พ.ศ. 2544	82
10 แสดงรายรับจากการลงทุนในสกุลเงินตราต่างประเทศของสถาบันการเงินท้องถิ่นแห่งหนึ่งในเขตอำเภอเมือง จังหวัดเชียงใหม่ ตั้งแต่เดือนมกราคม พ.ศ. 2545 ถึงเดือนเมษายน พ.ศ. 2545	83