

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ก
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	จ
สารบัญตาราง	ช
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 หลักการและเหตุผล	1
1.2 วัตถุประสงค์การศึกษา	3
1.3 ประโยชน์ที่ได้รับ	3
1.4 นิยามศัพท์	3
บทที่ 2 ทฤษฎี แนวคิดและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	
2.1 ทฤษฎีและแนวคิดที่เกี่ยวข้อง	5
2.2 งานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	8
บทที่ 3 ระเบียบวิธีการศึกษา	
3.1 ขอบเขตการศึกษา	12
3.2 วิธีการศึกษา	15
บทที่ 4 การวิเคราะห์ผลการศึกษา	
ส่วนที่ 4.1 การแสดงค่าสถิติพรรณนาและการแจกแจง	
ของอัตราผลตอบแทนจากหลักทรัพย์ และการ สรุปผล	24
ส่วนที่ 4.2 แสดงการเปรียบเทียบการทดสอบความสามารถ	
ในการประมาณมูลค่าความเสี่ยงของตัว แบบจำลอง และการสรุปผล	29
บทที่ 5 สรุปผลการศึกษา อภิปรายผล ข้อค้นพบ และข้อเสนอแนะ	
5.1 สรุปผลการศึกษา	35
5.2 อภิปรายผลการศึกษา	36
5.3 ข้อค้นพบ	38
5.4 ข้อเสนอแนะ	39

สารบัญ (ต่อ)

	หน้า
เอกสารอ้างอิง	40
ภาคผนวก	41
ประวัติผู้เขียน	47

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright© by Chiang Mai University
 All rights reserved

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
3.1 แสดงรายชื่อหลักทรัพย์ใน SET50 ที่นำมาทดสอบ	13
3.2 แสดงความน่าจะเป็นเมื่อกำหนดวันที่เกิดความเสียหายเกินกว่ามูลค่าความเสี่ยงที่กำหนด กำหนดที่ระดับความเชื่อมั่น 99%	20
3.3 แสดงการแบ่งช่วงของการยอมรับตัวแบบจำลอง ที่ระดับความเชื่อมั่น 99%	21
4.1 ตารางแสดงค่าสถิติพรรณนาและการแจกแจงของอัตราผลตอบแทนจากหลักทรัพย์	24
4.2 ตารางสรุปค่าสถิติพรรณนาและการแจกแจงของอัตราผลตอบแทนจากหลักทรัพย์	27
4.3 ตารางแสดงผลการคำนวณมูลค่าความเสี่ยง ผลการทดสอบการวัดมูลค่าความเสี่ยง และการ ทดสอบคุณภาพของตัวแบบจำลอง	29
4.4 ตารางสรุปแสดงผลการคำนวณมูลค่าความเสี่ยง ผลการทดสอบการวัดมูลค่าความเสี่ยง และการทดสอบคุณภาพของตัวแบบจำลอง	32