

## สารบัญ

	หน้า
บทคัดย่อ.....	(1)
กิตติกรรมประกาศ.....	(3)
สารบัญตาราง.....	(10)
สารบัญภาพประกอบ.....	(12)
บทที่	
1. บทนำ.....	1
ที่มาและความสำคัญของปัญหา.....	1
วัตถุประสงค์ของการศึกษา.....	2
ขอบเขตของการศึกษา.....	2
วิธีการศึกษา.....	3
แหล่งที่มาของข้อมูล.....	3
ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ.....	3
2. แนวคิดทางทฤษฎีและวรรณกรรมปริทัศน์.....	4
กรอบความคิดทางทฤษฎี.....	4
ทฤษฎีอรรถประโยชน์คาดหวัง.....	4
การกลัวความเสี่ยง.....	5
ทฤษฎีการวัดความเสี่ยงของ Arrow-Pratt.....	6
Prospect Theory.....	6
ทฤษฎีอรรถประโยชน์ของ Markowitz.....	7

กฎการเลือกที่เหมาะสม.....	9
Stochastic Dominance สำหรับคนกลัวความเสี่ยง.....	9
Stochastic Dominance สำหรับคนรักความเสี่ยง.....	12
Prospect Stochastic Dominance และ Markowitz	
Stochastic Dominance.....	14
วรรณกรรมปริทัศน์.....	18
3. วิธีการศึกษา.....	21
การทดสอบ Stochastic Dominance.....	21
การทดสอบ Stochastic Dominance สำหรับคนกลัวความเสี่ยง.....	21
การทดสอบ Stochastic Dominance สำหรับคนรักความเสี่ยง.....	24
การทดสอบ Markowitz Stochastic Dominance.....	26
การทดสอบ Prospect Stochastic Dominance.....	28
4. ผลการศึกษา.....	32
ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล.....	32
ผลการทดสอบ Stochastic Dominance.....	33
4. สรุปผลการศึกษา.....	41
สรุปและข้อเสนอแนะ.....	41
สรุป.....	41
ข้อเสนอแนะ.....	42
ข้อจำกัดในการศึกษา.....	43
6. บรรณานุกรม.....	44

ภาคผนวก.....	48
ก ผลการทดสอบ Ascending Stochastic Dominance ด้วยวิธี DD-Test.....	49
ข ผลการทดสอบ Descending Stochastic Dominance ด้วยวิธี DD-Test.....	52
ค ผลการทดสอบ Markowitz Stochastic Dominance ด้วยวิธี DD-Test.....	55
ง ผลการทดสอบ Prospect Stochastic Dominance ด้วยวิธี DD-Test.....	58
จ ผลการทดสอบ Ascending Stochastic Dominance ด้วยวิธี LMW-Test.....	61
ฉ ผลการทดสอบ Descending Stochastic Dominance ด้วยวิธี LMW-Test.....	64
ช ผลการทดสอบ Markowitz Stochastic Dominance ด้วยวิธี LMW-Test.....	67
ฌ ผลการทดสอบ Prospect Stochastic Dominance ด้วยวิธี LMW-Test.....	70
ฉ ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root) ด้วยวิธี ADF.....	73
ญ ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root) ด้วยวิธี PP.....	79
 ประวัติการศึกษา.....	 85