

แบบเสนอหัวข้อโครงการ
รายวิชา ค.462/คป.452 โครงการพิเศษ ประจำปีการศึกษา 2559

หัวข้อโครงการ

(ภาษาอังกฤษ) LTF Selection process using duration of cash flow with tax refund

(ภาษาไทย) กระบวนการเลือกกองทุน LTF โดยใช้ดูเรชันของกระแสเงินสดรับ
ที่รวมสิทธิประโยชน์ทางภาษี**รายชื่อสมาชิกในกลุ่ม**

- | | |
|--------------------------|-----------------------|
| 1. นางสาวปรีณา หนูช่วย | เลขทะเบียน 5709681240 |
| 2. นางสาวรัญญา ชุ่มโชคดี | เลขทะเบียน 5709681307 |
| 3. นายจักรกฤษณ์ สุรัสวดี | เลขทะเบียน 5709681349 |

อาจารย์ที่ปรึกษา ผศ.ดร.วิชัย วิทยาเกียรติเลิศ

ที่มาและวัตถุประสงค์โครงการ

โครงการนี้เป็นการนำวารสารวิชาการในหัวข้อ Duration and Convexity Formulas for Odd First Period Bonds มาต่อยอด โดยกลุ่มของข้าพเจ้าเล็งเห็นว่ากองทุน LTF นั้นมีการจ่ายเงินปันผลที่คล้ายคลึงกับตราสารหนี้ แต่จะมีสิ่งที่แตกต่างออกไปกล่าวคือเงินปันผลที่จ่ายจะมีอัตราที่ไม่เท่ากัน และไม่สามารถคาดเดาได้ ด้วยเหตุนี้กลุ่มของข้าพเจ้าจึงอยากจะต่อยอดสูตรดูเรชันเพื่อใช้คำนวณความน่าลงทุนของกองทุน LTF

ขอบเขตการศึกษาโครงการ

การศึกษาการลงทุนในกองทุน LTF พร้อมทั้งสิทธิประโยชน์ทางภาษีจากการลงทุน โดยใช้การคำนวณหาดูเรชันของกระแสเงินสดรับ

ระเบียบวิธีวิจัย

1. ศึกษาการลงทุนในกองทุน LTF และสิทธิประโยชน์ทางภาษีของแต่ละกองทุน
2. ศึกษานิยาม ทฤษฎี และงานวิจัยที่เกี่ยวข้องกับการคำนวณหาดูเรชัน ที่มีกระแสเงินสดรับไม่คงที่
3. คัดกรองกองทุน LTF 10 กองทุน โดยใช้ข้อมูลย้อนหลัง 10 ปี เพื่อนำมาคำนวณโดยใช้สูตรดูเรชันของกระแสเงินสดรับ และนำมาประเมินถึงความน่าลงทุนของกองทุนนั้นๆ
4. สรุปผลการศึกษาและรวบรวมข้อเสนอแนะเพื่อนำไปพัฒนาการวิจัย


ผลที่คาดว่าจะได้รับ

สามารถหาสูตรดูเรชันคำนวณความนำลงทุนของกองทุน LTF เพื่อนำไปใช้เป็นอีกหนึ่ง

ตัวเลือกในการตัดสินใจในการลงทุน LTF

นักศึกษา

1. นางสาวปรีณา หนูช่วย
2. นางสาววรรษญา ชุ่มโชคดี
3. นายจักรกฤษณ์ สุรัสวดี

()
(ศัญญา ภูมิชาติ)
(ศศ. จักรกฤษณ์ สุรัสวดี)

ลงชื่อ



อาจารย์ที่ปรึกษา

(ผศ.ดร.วิชัย วิทยาเกียรติเลิศ)

วันที่ 5 กุมภาพันธ์ 2561