

การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่ม  
บันเทิงและสันทนาการโดยวิธีโคอินทิเกรชัน

เอนก อุปรา

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง  
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

บัณฑิตวิทยาลัย  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

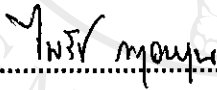
พฤษภาคม 2547

การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่ม  
บ้านเทิงและสันทนาการโดยวิธีโคอินทิเกรชัน

เอนก อุปรา

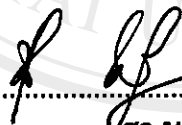
การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่ง  
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ



ประธานกรรมการ

อ.ดร.ไพรัช กาญจนการณ



กรรมการ

ผศ.ธเนศ ศรีวิชัยลาพันธ์



กรรมการ

อ.ดร.นิสิต พันธมิตร

19 พฤษภาคม 2547

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

## กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้สำเร็จลงได้ด้วยความกรุณาเป็นอย่างยิ่งจากอาจารย์ที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระของข้าพเจ้า นั่นก็คือ อาจารย์ ดร.ไพรัช กาญจนการุณ ผู้ซึ่งกรุณาให้ความรู้คำแนะนำและคำปรึกษา รวมทั้งการตรวจทานแก้ไขจนกระทั่งการค้นคว้าแบบอิสระนี้เสร็จสมบูรณ์โดยดี ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณ อาจารย์ ดร.นิสิต พันธมิตร และ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ธนศ ศรีวิชัยลำพันธ์ ที่กรุณาเป็นกรรมการตรวจสอบการค้นคว้าแบบอิสระ และให้คำแนะนำข้อคิดเห็นที่เป็นประโยชน์ต่อการศึกษาก่อนอย่างคิดตลอดมา

ขอกราบขอบพระคุณอาจารย์ ดร. ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ ที่กรุณาให้แนวคิดในการศึกษา อีกทั้งยังคอยช่วยเหลือแนะนำในด้านการศึกษาในคณะเศรษฐศาสตร์นี้

ขอขอบคุณบรรณารักษ์ ห้องสมุดคณะเศรษฐศาสตร์ และเจ้าหน้าที่คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ทุกท่านที่ช่วยอำนวยความสะดวกในด้านต่างๆ เป็นอย่างดีทั้งในและนอกเวลาทำงานเป็นอย่างดีตลอดมา

ขอขอบคุณ คุณกรรมกร ไซยลังกา ที่คอยช่วยเหลือและให้คำปรึกษา จนทำให้การศึกษานี้สำเร็จลุล่วงได้ด้วยดี

ขอขอบคุณเพื่อน ๆ ทุกคน ที่คอยเป็นแรงกระตุ้น ทำให้การศึกษารั้งนี้สำเร็จลงได้ตามเวลาที่กำหนด

ขอขอบคุณ คุณนาวิน อุปรา ที่คอยช่วยหาข้อมูลต่าง อีกทั้งเป็นกำลังใจให้ตลอดมา

ขอกราบขอบพระคุณ คุณพ่อและคุณแม่ ที่คอยส่งเสริมและคอยให้กำลังใจเสมอมา รวมทั้งให้โอกาสในการศึกษา

เอนก อุปรา