

การวิเคราะห์ผลตอบแทนและความเสี่ยงของหุ้นการเงินในตลาดหลักทรัพย์
แห่งประเทศไทยโดยใช้แบบจำลองเอพีที



เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
มิถุนายน 2549

การวิเคราะห์ผลตอบแทนและความเสี่ยงของหุ้นการเงินในตลาดหลักทรัพย์
แห่งประเทศไทยโดยใช้แบบจำลองเอพีที

ชาติชาย ศิริจันทร์

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
มิถุนายน 2549

การวิเคราะห์ผลตอบแทนและความเสี่ยงของหุ้นการเงินในตลาดหลักทรัพย์
แห่งประเทศไทยโดยใช้แบบจำลองเอพีที



ชาติชาย ศิริจันทร์

การค้นคว้าแบบอิสระได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

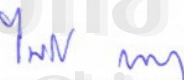


ประธานกรรมการ

รศ.ดร.อารี วิบูลย์พงศ์

กรรมการ

รศ.ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์



กรรมการ

อาจารย์ ดร.ไพรัช กาญจนการุณ

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

2 มิถุนายน 2549

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้สำเร็จลงได้ด้วยความรู้จาก รองศาสตราจารย์ ดร. อารี วิบูลย์พงศ์ ประธานที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ ที่กรุณาให้ความรู้ คำแนะนำ เป็นที่ปรึกษา และตรวจแก้ไขจนการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้เสร็จสมบูรณ์ ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณ รศ. ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอาจารย์ ดร.ไพรัช กาญจนการุณ ที่รับเป็นกรรมการตรวจสอบการค้นคว้าแบบอิสระ และให้คำแนะนำเป็นอย่างดีตลอดมา

ขอกราบขอบพระคุณอาจารย์ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์กุล รวมถึงอาจารย์ทุกท่านที่กรุณาให้ความรู้ คำแนะนำต่างๆทั้งที่เกี่ยวกับการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และเทคนิคการประมวลผลข้อมูลด้วยโปรแกรมคอมพิวเตอร์ต่างๆ

ขอขอบคุณอาจารย์ ณิชทรพงษ์ แก้วสมพงษ์ รวมทั้งเจ้าหน้าที่ของศูนย์การเงินและการลงทุนที่กรุณาอำนวยความสะดวกในข้อมูลที่ใช้ในการค้นคว้าแบบอิสระครั้งนี้

ขอขอบคุณ คุณวราภรณ์ พัฒนเกียรติพงศ์ บรรณารักษ์ และเจ้าหน้าที่ห้องสมุดคณะเศรษฐศาสตร์ และเจ้าหน้าที่ประจำคณะเศรษฐศาสตร์ทุกท่านที่ได้ให้คำแนะนำในการแก้ไข และอำนวยความสะดวกในการการค้นคว้าแบบอิสระครั้งนี้

ขอกราบขอบพระคุณ คุณแม่ และครอบครัว ที่ได้ให้โอกาสทางการศึกษาและสนับสนุนผู้เขียนทั้งทางด้านกำลังใจและกำลังทรัพย์ด้วยดีเสมอ

สุดท้ายนี้หากการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้มีข้อผิดพลาดประการใด ผู้เขียนขออภัยไว้ ณ ที่นี้ด้วย ผู้เขียนหวังว่าการค้นคว้าแบบอิสระฉบับจะเป็นประโยชน์ต่อผู้ที่สนใจศึกษาต่อไป

ชาติชาย ศิริจันทร์