

ชื่อเรื่องการค้าคั่วแบบอิสระ

การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่ม  
อุตสาหกรรมอาหาร ในตลาดหลักทรัพย์  
แห่งประเทศไทย โดยวิริมอนติคาโล

ผู้เขียน

นายอัยยรัช ชลิตพงษ์

ปริญญา

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้าคั่วแบบอิสระ

รศ.ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์

ประธานกรรมการ

รศ.ดร.อารี วิบูลย์พงศ์

กรรมการ

อ.ดร.ไพรัช กาญจนการุณ

กรรมการ

## บทคัดย่อ

การศึกษาเรื่อง การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มอุตสาหกรรมอาหารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิริมอนติคาโล มีวัตถุประสงค์เพื่อวิเคราะห์ความเสี่ยงในการลงทุนในหุ้นอุตสาหกรรมอาหาร โดยวิริมอนติคาโล หลักทรัพย์ที่ใช้ในการศึกษา คือ บริษัท เชียงใหม่ไฟรเซนฟู๊ดส์ จำกัด(มหาชน) บริษัทไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน) บริษัท โออิชิ กรุ๊ป จำกัด (มหาชน) บริษัท เพอร์ซิเดนท์ เบเกอรี่ จำกัด (มหาชน) บริษัท เอส แอนด์ พี ซินดิเคท จำกัด (มหาชน) และ บริษัท ยูนิวานิชน้ำมันปาล์ม จำกัด (มหาชน) การศึกษานี้ใช้ข้อมูลทุติยภูมิ จากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ซึ่งเป็นข้อมูลราคาปิดรายวันของหุ้นที่ทำการซื้อขายอยู่ในตลาดช่วงระยะเวลา 3 ปี

ผลการศึกษาพบว่า ที่ระดับนัยสำคัญเท่ากับร้อยละ 10 ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ บริษัท เชียงใหม่ไฟรเซนฟู๊ดส์ จำกัด(มหาชน) บริษัทไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน) บริษัท โออิชิ กรุ๊ป จำกัด (มหาชน) บริษัทเพอร์ซิเดนท์ เบเกอรี่ จำกัด (มหาชน) บริษัท เอส แอนด์ พี ซินดิเคท จำกัด (มหาชน) บริษัท ยูนิวานิชน้ำมันปาล์ม จำกัด (มหาชน) มีค่าเท่ากับ 2.46 4.67 7.00 26.45 7.93 และ 12.16 ตามลำดับ สำหรับการทดสอบที่ระดับนัยสำคัญเท่ากับร้อยละ 5 ผล

การศึกษพบว่าความเสี่ยงของหลักทรัพย์ บริษัท เชียงใหม่โฟรเซนฟู้ดส์ จำกัด(มหาชน) บริษัท ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน) บริษัท โออิชิ กรุ๊ป จำกัด (มหาชน) บริษัทเพรซิเดนท์ เบเกอร์ จำกัด (มหาชน) บริษัทเอส แอนด์ พี ซินดิเคท จำกัด (มหาชน) บริษัท ยูนิวานิช น้ำมันปาล์ม จำกัด (มหาชน) มีค่าเท่ากับ 2.67 5.50 8.26 32.02 9.67 และ14.58 ตามลำดับ นอกจากนี้ ผลการศึกษายังพบว่าที่ระดับนัยสำคัญเท่ากับร้อยละ 1 ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ บริษัท เชียงใหม่โฟรเซนฟู้ดส์ จำกัด(มหาชน) บริษัท ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน) บริษัท โออิชิ กรุ๊ป จำกัด (มหาชน) บริษัทเพรซิเดนท์ เบเกอร์ จำกัด (มหาชน) บริษัทเอส แอนด์ พี ซินดิเคท จำกัด (มหาชน) บริษัท ยูนิวานิชน้ำมันปาล์ม จำกัด (มหาชน) มีค่าเท่ากับ 2.97 6.88 10.07 40.06 12.70 และ 18.67 ตามลำดับ

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University  
All rights reserved

<b>Independent Study Title</b>	Risk Analysis of Securities in the Food and Beverage Sector in the Stock Exchange of Thailand Using Monte Carlo Method
<b>Author</b>	Mr. Aiyarat Chalitpong
<b>Degree</b>	Master of Economics
<b>Independent Study Advisory Committee</b>	Assoc. Prof. Dr. Songsak Sriboonchitta Chairperson Assoc. Prof. Dr. Aree Wiboonpongse Member Lect. Dr. Pairat Kanjanakaroon Member

### **ABSTRACT**

This study analyzed the risks of investment in the Agro and Food Industry in the Stock Exchange of Thailand (SET) using Monte Carlo estimation method. The assets under study were Chiangmai Frozen Foods, Minor International, Oishi Group, President Bakery, S&P Syndicate, and Univanich Palm Oil, all being public companies (limited). It was based on secondary data, daily closing prices of these assets traded in SET for the past 3 years.

The results indicated at the statistical significant level of 10%, the risks of the following assets: CM, MINT, OISHI, PB, S&P, and UVAN, had the values of 2.46, 4.67, 7.00, 26.45, 7.93 and 12.16, respectively. At the statistical significant level of 5% the risk values of these assets became 2.67, 5.50, 8.26, 32.02, 9.67, and 14.58, respectively. And at the statistical significant level of 1%, the risk values of these assets changed to 2.97, 6.88, 10.07, 40.66, 12.70 and 18.67, respectively.