

การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ในกลุ่ม ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์ในตลาด  
หลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
Copyright© by Chiang Mai University  
All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
กันยายน 2552

การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ในกลุ่ม ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์ในตลาด  
หลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน



การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง  
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
Copyright© by Chiang Mai University  
All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
กันยายน 2552

การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ในกลุ่ม ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์ในตลาด  
หลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน

ศรินญา หลวงสา

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา  
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

ไพรัช

ประธานกรรมการ

ผศ.ดร. ไพรัช กาญจนการุณ

อ.ดร. สังคม สุวรรณรัตน์

กรรมการ

อ.ดร. ประพัฒน์ จริยะพันธุ์

กรรมการ

อ.ดร. ประพัฒน์ จริยะพันธุ์

ผศ.ดร. นิสิต พันธมิตร

กรรมการ

10 กันยายน 2552

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

## กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ คงไม่สามารถสำเร็จลุล่วงไปได้ด้วยดีโดยปราศจากบุคคลสำคัญดังต่อไปนี้

อาจารย์ ดร.ประพัฒน์ จริยะพันธุ์ อาจารย์ที่ปรึกษา ผู้ที่ได้ทุ่มเทเสียสละเวลาที่มีค่าในการอ่านและตรวจการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ พร้อมทั้งบอกกล่าวข้อบกพร่องและข้อเสนอแนะที่มีประโยชน์ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.ไพรัช กาญจนการุณ ประธานกรรมการสอบ อาจารย์ ดร.สังคม สุวรรณรัตน์ และ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.นิสิต พันธมิตร กรรมการสอบ ผู้ซึ่งคอยให้ข้อคิดเห็นและคำวิจารณ์ในประเด็นต่างๆที่มีประโยชน์ต่อการพัฒนาการค้นคว้าแบบอิสระให้ดีขึ้น บุคคลทั้งสี่ท่านข้างต้นรวมถึงอาจารย์ท่านอื่นๆในคณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

นอกจากบุคคลดังกล่าวแล้ว ยังมีบุคคลต่างๆอีกมากมายที่มีส่วนช่วยให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สำเร็จลุล่วงไปได้ ผู้เขียนขอขอบคุณเพื่อนๆในคณะเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต หลักสูตร 1 ปี มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ นอกจากนี้ ผู้เขียนขอขอบคุณเจ้าหน้าที่ทุกท่าน ที่เอื้ออำนวยความสะดวกในด้านต่างๆที่เกี่ยวข้องกับขั้นตอนในการทำการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้

ที่สำคัญที่สุด ผู้เขียนขอขอบคุณครอบครัวของผู้เขียนซึ่งประกอบด้วย พ่อ แม่ และพี่น้องของผู้เขียน ผู้ซึ่งเป็นบุคคลที่มีความสำคัญมากที่สุดในชีวิตของผู้เขียน ที่คอยให้กำลังใจ ให้คำแนะนำและคอยตักเตือนในยามที่ผู้เขียนทำผิดพลาด เพื่อช่วยให้ผู้เขียนทำการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ให้สำเร็จลุล่วงไปได้

นอกจากนี้ ยังมีบุคคลอื่นๆที่มีพระคุณต่อผู้เขียนแต่คงไม่สามารถเอ่ยนามได้หมด ซึ่งผู้เขียนขอขอบคุณมาไว้ ณ ที่นี้ด้วย

คุณความดีใดๆที่พึงมีจากการทำการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ ผู้เขียนขอมอบแด่บุคคลต่างๆที่ผู้เขียนได้กล่าวถึงข้างต้น และหากการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้มีข้อบกพร่องประการใด ผู้เขียนยินดีรับฟังและขอน้อมรับไว้แต่เพียงผู้เดียว