

การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์
ในกลุ่มดัชนี SET 50 ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
โดยใช้แบบจำลองสามปัจจัย

ขวัญฤทัย วชิรพันธ์สถิต

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
บริหารธุรกิจมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

เมษายน 2550

การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มดัชนี SET 50
ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้แบบจำลองสามปัจจัย

ขวัญฤทัย วชิรพันธ์สถิต

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

..... ประธานกรรมการ
ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.รวิ ลังกานี

..... กรรมการ
รองศาสตราจารย์ สิริเกียรติ รัชชานันติ

..... กรรมการ
ผู้ช่วยศาสตราจารย์ สุวรรณ์พันธ์ สุวรรณพันธ์

23 เมษายน 2550

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ สำเร็จลงได้ด้วยความกรุณาจาก ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.วีลงภาณี อาจารย์ที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ ผู้ซึ่งกรุณาให้ความรู้ คำแนะนำในการค้นคว้า ตรวจสอบ แก้ไขข้อบกพร่องต่างๆ ด้วยความเอาใจใส่อย่างยิ่ง จนการค้นคว้าอิสระนี้สำเร็จสมบูรณ์ ผู้ทำการศึกษา ขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณ รองศาสตราจารย์ศิริเกียรติ รัชชสถานติ และ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ สุจรรย์พันธ์ สุวรรณพันธ์ ที่กรุณาร่วมเป็นกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ และให้คำแนะนำเป็นอย่างดี ขอกราบขอบพระคุณคณาจารย์คณะบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ รวมถึงคณาจารย์ผู้ร่วมสอนทุกท่าน ที่ได้ประสิทธิ์ประสาทวิชาองค์ความรู้ต่างๆ จนผู้ศึกษาสามารถนำวิชาความรู้ที่ได้ศึกษามาประกอบการจัดทำรายงานการค้นคว้าแบบอิสระนี้

ขอขอบคุณ คุณนพพร อินตา ที่เป็นกำลังใจ และ ให้ความช่วยเหลือในด้านต่างๆ มาโดยตลอด ขอขอบคุณเจ้าหน้าที่คณะบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ทุกท่าน ที่อำนวยความสะดวก และช่วยเหลือประสานงานด้วยดีตลอดมา

เหนือสิ่งอื่นใด ข้าพเจ้าขอกราบขอบพระคุณบิดาและมารดา ขอขอบคุณพี่สาว และทุกคนในครอบครัวที่ได้ให้การสนับสนุน และเป็นกำลังใจในการศึกษาตลอดมา จนทำให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สำเร็จลุล่วงด้วยดี

ขวัญฤทัย วชิรพันธ์สถิต