

การวิเคราะห์ผลตอบแทนของการลงทุนในหลักทรัพย์

กลุ่มชิ้นส่วนยานพาหนะด้วยวิธีการ

เส้นพรมแดนเชิงเส้น

ปัทมกร ตั้งเมธิกุล

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง

ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

พฤษภาคม 2547

การวิเคราะห์ผลตอบแทนของการลงทุนในหลักทรัพย์  
กลุ่มหุ้นส่วนยานพาหนะด้วยวิธีการ  
เส้นพรมแดนเชิงเฟ้นสุ่ม

ปัทมกร ตั้งเมธิกุล

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา  
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

..... ประธานกรรมการ

ผศ. ดร. ศติเพ็ญ พวงสายใจ

..... กรรมการ

อ. ดร. ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์

..... กรรมการ

อ. ดร. ไพรัช กาญจนการุณ

25 พฤษภาคม 2547

© ลิขสิทธิ์ของบัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

## กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้สำเร็จลงได้ด้วยความกรุณาจาก ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.ศศิเพ็ญ พวงสายใจ ประธานที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ ผู้ซึ่งกรุณาให้ความรู้ คำแนะนำ คำปรึกษา และตรวจแก้ไขงานการค้นคว้าแบบอิสระเสร็จสมบูรณ์ ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณ อาจารย์ ดร. ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ อาจารย์ ดร. ไพรัช กาญจนการุณ ที่กรุณาได้รับเป็นกรรมการตรวจสอบการค้นคว้าแบบอิสระ และให้คำแนะนำเป็นอย่างดีตลอดมา

ขอขอบคุณ อาจารย์ผไทรัตน์ ภาสกรพิพัฒน์กุล อาจารย์ชัยวัฒน์ และ อาจารย์กัญสุดา นิมอนุสรณ์กุล ที่กรุณาให้ความรู้และคำแนะนำต่าง ๆ เกี่ยวกับคอมพิวเตอร์และระบบสารสนเทศ ตลอดระยะเวลาของการประมวลผลข้อมูล และเจ้าหน้าที่ของศูนย์การเงินและการลงทุน มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ ที่กรุณาให้ความอนุเคราะห์ข้อมูลเกี่ยวกับหลักทรัพย์สำหรับการศึกษาวิจัย ครั้งนี้ และขอขอบคุณคณาจารย์ทุกท่านใน โครงการปริญญาโท เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต ภาคพิเศษ 1 ปี ที่ช่วยประสิทธิประสาทวิชาความรู้ รวมถึงให้คำแนะนำที่ดีเสมอมา

ขอขอบคุณบรรณารักษ์ ห้องสมุดคณะเศรษฐศาสตร์ และเจ้าหน้าที่ประจำคณะเศรษฐศาสตร์ ทุกท่าน ที่ได้ให้ความอนุเคราะห์ในด้านต่าง ๆ รวมทั้งญาติทุกคน โดยเฉพาะอย่างยิ่ง คุณพ่อ คุณแม่ ที่ได้ให้ความช่วยเหลือและเป็นกำลังใจในการทำ การค้นคว้าแบบอิสระนี้ และขอขอบคุณเพื่อน ๆ นักศึกษาปริญญาโทสาขาเศรษฐศาสตร์รุ่นที่ 2 (ภาคพิเศษ) ทุกท่านที่ให้ความช่วยเหลือมาโดยตลอด

ท้ายที่สุดนี้ หากมีสิ่งขาดตกบกพร่องหรือผิดพลาดประการใด ผู้เขียนขออภัยเป็นอย่างสูงใน ข้อบกพร่องและความผิดพลาดนั้น และผู้เขียนหวังว่าการค้นคว้าแบบอิสระนี้ จะเป็นประโยชน์และแนวทางแก่ผู้สนใจรวมถึงผู้ที่สนใจการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์บ้าง ไม่มากก็น้อย