

**การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคาร
พาณิชย์ขนาดใหญ่ด้วยวิธีการเส้นพรมแดนเชิงเส้น**

อรรรรณ โพธิบุตร

**การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต**

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

**บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่**

พฤษภาคม 2547

การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคาร
พาณิชย์ขนาดใหญ่ด้วยวิธีการเส้นพรมแดนเชิงเส้นสัมพันธ์

อรรรรณ ไพธิบุตร

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

.....ประธานที่ปรึกษา

ผศ.ดร. ศศิเพ็ญ พวงสายใจ

.....กรรมการ

ดร. ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์

.....กรรมการ

ดร. ไพรัช กาญจนการณ

25 พฤษภาคม 2547

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระสำเร็จได้ด้วยความรู้และการอนุเคราะห์อย่างสูงจาก ผศ.ดร. ศศิเพ็ญ พวงสายใจ อาจารย์ที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ เป็นผู้ซึ่งให้ความรู้ คำแนะนำและตรวจจสอบแก้ไขมาตลอด จนการค้นคว้าแบบอิสระเสร็จสมบูรณ์ ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูง ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณ ดร. ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และดร. ไพรัช กาญจนการุณ ที่กรุณาเป็นกรรมการตรวจจสอบและให้คำแนะนำที่ดี รวมทั้งคณาจารย์และผู้เกี่ยวข้องทุกท่าน

ขอขอบคุณ อาจารย์ผไทรัตน์ ภาสกรพิพัฒน์กุล อาจารย์ชัยวัฒน์ และอาจารย์กัญสุดา นิมอนุสรณ์กุล ที่กรุณาให้ความรู้และคำแนะนำต่างๆ รวมทั้งคุณพ่อ คุณแม่และญาติพี่น้องทุกคนที่เป็นกำลังใจและให้ความช่วยเหลือในการทำ การค้นคว้าแบบอิสระ

ท้ายที่สุดนี้ การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ หากมีสิ่งใดบกพร่องและผิดพลาดประการใด ขออภัยเป็นอย่างสูง และหวังอย่างยิ่งว่าการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้จะเป็นประโยชน์ต่อนักลงทุนและผู้สนใจที่จะศึกษาต่อไปในอนาคต

อรรรรณ ไพธิบุตร