

การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อผลตอบแทนของหุ้นในกลุ่มยานพาหนะ
และชิ้นส่วนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
โดยแบบจำลองฟาร์มาและเฟรนช์

พริ้มเพรา มณีศรีวงศ์กุล

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
เมษายน 2548

การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อผลตอบแทนของหุ้นในกลุ่มยานพาหนะ
และชิ้นส่วนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
โดยแบบจำลองฟาร์มาและเฟรนช์

พริ้มเพรา มณีศรีวงศ์กุล

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต


บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
เมษายน 2548

การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อผลตอบแทนของหุ้นในกลุ่มยานพาหนะ
และชิ้นส่วนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
โดยแบบจำลองฟาร์มาและเฟรนช์


พริ้มเพรา มณีศรีวงศ์กุล

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ


.....ประธานกรรมการ

ผศ. ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์


.....กรรมการ

ผศ.สุรภร วิเศษสุวรรณ


.....กรรมการ

ผศ.กาญจนา โชคถาวร

18 เมษายน 2548

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้สำเร็จลุล่วงไปได้ด้วยความกรุณาและความอนุเคราะห์ช่วยเหลือจากคณาจารย์และผู้มีพระคุณทุกท่านเป็นอย่างดี โดยเฉพาะอย่างยิ่งผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์ ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณท่านเป็นอย่างสูงที่ได้สละเวลาอันมีค่าสำหรับการรับเป็นอาจารย์ที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ รวมถึงการให้คำปรึกษาและแนะนำแนวทางในการศึกษา ด้วยดีมาตลอด จนการค้นคว้าแบบอิสระเสร็จสมบูรณ์

ขอกราบขอบพระคุณ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ สุรภร วิศิษฐ์สุวรรณ และผู้ช่วยศาสตราจารย์ กาญจนา โชคถาวร ที่กรุณารับเป็นกรรมการที่ปรึกษาและให้คำแนะนำที่เป็นอย่างคิดตลอดมา

ขอขอบคุณ อาจารย์ไพฑูริรัตน์ ภาสกรพิพัฒนกุล ที่กรุณาให้ความรู้และคำแนะนำต่าง ๆ เกี่ยวกับการใช้โปรแกรมคอมพิวเตอร์ในการประมวลผลข้อมูล คุณวรารักษ์ พัฒนเกียรติพงศ์ และเจ้าหน้าที่คณะเศรษฐศาสตร์ที่มีส่วนช่วยทำให้งานวิจัยครั้งนี้สำเร็จลุล่วงไปได้ด้วยดี เพื่อนๆที่คอยให้ความช่วยเหลือในทุกๆด้าน คุณอภิศักดิ์ พูลสวัสดิ์ ที่กรุณาช่วยหาข้อมูลและเป็นกำลังใจที่ดีมาตลอด

ขอกราบขอบพระคุณ คุณพ่อไมตรี มณีศรีวงศ์กุล คุณแม่จารุพันธ์ มณีศรีวงศ์กุล และคุณอินทรา เสดะจันทน์ ที่ได้ให้โอกาสทางการศึกษา ความรักและกำลังใจในการทำการค้นคว้าแบบอิสระนี้ด้วยดีเสมอมา

ท้ายที่สุดนี้ หากมีสิ่งใดขาดตกบกพร่องหรือผิดพลาดประการใด ผู้เขียนขอภัยเป็นอย่างสูงในข้อบกพร่องและความผิดพลาดนั้น ผู้เขียนหวังอย่างยิ่งว่าการค้นคว้าแบบอิสระนี้มีประโยชน์บ้างไม่มากนักน้อยสำหรับผู้ที่มีความสนใจการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

พริ้มเพรา มณีศรีวงศ์กุล