

การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนหลักทรัพย์ในกลุ่มเคมีภัณฑ์
และพลาสติกในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้
แบบจำลองฟามาและเฟรนช์

จิราภรณ์ ก้นชาหล้า

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
พฤษภาคม 2548

การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนหลักทรัพย์ในกลุ่มเคมีภัณฑ์
และพลาสติกในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้
แบบจำลองฟามาและเฟรนช์

จิราภรณ์ ก้นชาหล้า

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
พฤษภาคม 2548



การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนหลักทรัพย์ในกลุ่มเคมีภัณฑ์
และพลาสติกในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้
แบบจำลองฟاماและเฟรนช์

จิราภรณ์ กันธาล้ำ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

.....ประธานกรรมการ
ผศ.ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์

.....กรรมการ
ผศ.สุรกร วิเศษสุวรรณ

.....กรรมการ
ผศ.กาญจนา โชคถาวร

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

9 พฤษภาคม 2548

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้สำเร็จลงได้ด้วยความกรุณาจาก ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร. ประเสริฐ ไชยทิพย์ อาจารย์ที่ปรึกษาการค้นคว้าอิสระ ผู้ซึ่งกรุณาให้ความรู้ คำแนะนำ คำปรึกษา และตรวจแก้ไขงานการค้นคว้าอิสระเสร็จสมบูรณ์ ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ สุรภร วิศิษฐ์สุวรรณ และผู้ช่วยศาสตราจารย์ กาญจนา โชคถาวร ที่กรุณารับเป็นกรรมการตรวจสอบการค้นคว้าอิสระ และให้คำแนะนำเป็นอย่างดีตลอดมา

ขอขอบคุณเจ้าหน้าที่ศูนย์การเงินและการลงทุนที่กรุณาให้ความรู้ในการค้นหาข้อมูลเกี่ยวกับหลักทรัพย์ และขอขอบคุณคุณพ่อ คุณแม่ ที่ให้กำลังใจเป็นอย่างดีเสมอมา

ท้ายที่สุดนี้ หากมีสิ่งใดขาดตกบกพร่องหรือผิดพลาดประการใด ผู้เขียนขออภัยเป็นอย่างสูงในข้อบกพร่องและความผิดพลาดนั้น และผู้เขียนหวังว่าวิทยานิพนธ์นี้คงจะมีประโยชน์บ้างไม่มากนักน้อยสำหรับหน่วยงานที่เกี่ยวข้องตลอดจนผู้ที่สนใจศึกษารายละเอียดเกี่ยวกับราคาหลักทรัพย์ต่อไป

จิราภรณ์ กันธาห้ำ