

การวิเคราะห์ผลตอบแทนของการลงทุนในหลักทรัพย์กลุ่มพาณิชย์
ด้วยวิธีการเส้นพรมแดนเชิงเฟ้นสุ่ม

นันทวัน กันมา

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

พฤษภาคม 2547

การวิเคราะห์ผลตอบแทนของการลงทุนในหลักทรัพย์กลุ่มพาณิชย์
ด้วยวิธีการเส้นพรมแดนเชิงเส้น

นันทวัน กันมา

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

.....ประธานกรรมการ

ผศ. ดร. ศติเพ็ญ พวงสายใจ

.....กรรมการ

อาจารย์ ดร. ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์

.....กรรมการ

อาจารย์ ดร. ไพรัช กาญจนการุณ

ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

25 พฤษภาคม 2547

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

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

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

ขอขอบคุณ อาจารย์ผด้อยรัตน์ ภาสกรพิพัฒน์กุล อาจารย์ชัยวัฒน์ และอาจารย์กัญสุดา นิ่มอนุสรณ์กุล ที่กรุณาให้ความรู้เกี่ยวกับระบบสารสนเทศ การใช้คอมพิวเตอร์ ตลอดระยะเวลาของการประมวลผลข้อมูล และขอขอบคุณเจ้าหน้าที่ของศูนย์การเงินและการลงทุน มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ ที่กรุณาให้ความอนุเคราะห์ข้อมูลเกี่ยวกับหลักทรัพย์สำหรับการศึกษาค้นคว้าครั้งนี้

ขอขอบคุณบรรณารักษ์ ห้องสมุดคณะเศรษฐศาสตร์ และเจ้าหน้าที่ประจำคณะเศรษฐศาสตร์ทุกท่าน ที่ได้ให้ความอนุเคราะห์ในด้านต่าง ๆ ด้วยดีเสมอมา

ขอกราบขอบพระคุณ คุณพ่อ คุณแม่ ที่ได้ให้ความช่วยเหลือ สนับสนุนในด้านต่าง ๆ และเป็นกำลังใจในการทำ การค้นคว้าแบบอิสระนี้ และขอบคุณเพื่อน ๆ นักศึกษาปริญญาโท สาขาเศรษฐศาสตร์รุ่นที่ 2 (ภาคพิเศษ) ทุกท่านที่ให้ความช่วยเหลือมาโดยตลอด

ท้ายที่สุดนี้ หากมีสิ่งขาดตกบกพร่องหรือผิดพลาดประการใด ผู้เขียนขออภัยเป็นอย่างสูงในข้อบกพร่องและความผิดพลาดนั้น และผู้เขียนหวังว่าการค้นคว้าแบบอิสระนี้ คงจะเป็นประโยชน์สำหรับนักลงทุนบ้าง ไม่น่าก็น้อย ตลอดจนถึงผู้สนใจเกี่ยวกับตราสารทางการเงินเพื่อใช้เป็นแนวทางในการศึกษารายละเอียดเกี่ยวกับหลักทรัพย์ต่อไป