

การวิเคราะห์ความเลียงและผลตอบแทนของหุ่นกลุ่มพลังงาน

โดยวิธี ควอนไทล์ รีเกรสชัน

จิราธิป ชนะชัย

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กันยายน 2553

การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหุ้นกลุ่มพลังงาน

โดยวิธีควอนไทล์ รีเกรสชัน

จิราธิป ชนะชัย

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง

ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กันยายน 2553

การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทน ของหุ้นกลุ่มพลังงาน

โดยวิธี ควอนไทล์ รีเกรสชัน

จิราธิป ชนะชัย

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ

.....ประธานกรรมการ

.....อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก

ผศ.ดร.เรียงชัย ต้นสุชาติ

รศ.ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์

.....กรรมการ

.....อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

รศ.ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์

รศ.ดร.กาญจนา โชคถาวร

.....กรรมการ

รศ.ดร.กาญจนา โชคถาวร

3 กันยายน 2553

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้สำเร็จลุล่วงลงได้ด้วยความกรุณาของ รศ.ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์ ประธานที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ ที่ได้กรุณาให้ความรู้ คำแนะนำ และคำปรึกษาที่เป็นประโยชน์ต่อการศึกษา อีกทั้งยังให้ความช่วยเหลือและให้การสนับสนุนในทุกๆ ด้านอย่างดี รวมถึงการตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องต่างๆ ซึ่งผู้เขียนขอขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอขอบพระคุณ รศ.ดร.กาญจนา โชคถาวร และ รศ.อารีย์ เชื้อเมืองพาน กรรมการการค้นคว้าแบบอิสระที่ได้ให้ข้อเสนอแนะที่มีคุณค่าต่อการศึกษา พร้อมทั้งตรวจสอบข้อผิดพลาดต่างๆ อันส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สมบูรณ์มากยิ่งขึ้น

ขอขอบพระคุณ ดร.ชูเกียรติ ชัยบุญศรี ที่ได้ให้ความรู้ และ ช่วยเหลือด้านต่างๆจนการค้นคว้าแบบอิสระครั้งนี้สำเร็จลุล่วงลงได้ ขอขอบพระคุณคณาจารย์คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ ที่ได้ให้ความรู้ด้านเศรษฐศาสตร์ ขอขอบคุณข้าราชการ เจ้าหน้าที่ ตลอดจนบรรณารักษ์ห้องสมุดของคณะเศรษฐศาสตร์ ที่ให้คำแนะนำช่วยเหลือ บริการประสานงานและอำนวยความสะดวกต่างๆ เป็นอย่างดีตลอดระยะเวลาที่ศึกษา

ขอขอบคุณเพื่อนๆทุกคน รวมไปถึงพี่ๆ นักศึกษาปริญญาโทเศรษฐศาสตร์ ทั้งหลักสูตร 1 ปี รุ่นที่ 8 ที่คอยให้กำลังใจ และสนับสนุนในการศึกษาครั้งนี้จนสำเร็จได้สมบูรณ์

สุดท้ายนี้หากการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้จะเป็นประโยชน์แก่งานที่เกี่ยวข้อง ตลอดจนผู้สนใจข้อมูล ผู้เขียนขอแสดงความดีใจให้แก่คุณพ่อ คุณแม่ ผู้ที่ให้การดูแลและเป็นกำลังใจที่สำคัญยิ่งในการศึกษามาจนทุกวันนี้ ในส่วนของความผิดพลาดหรือข้อบกพร่องประการใด ผู้เขียนขอน้อมรับไว้เพียงผู้เดียว