

การวิเคราะห์ความเสี่ยงตามฤดูกาลของหลักทรัพย์กลุ่มเงินทุน
และหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย



เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กันยายน 2548

ISBN 974-9887-92-1

การวิเคราะห์ความเสี่ยงตามฤดูกาลของหลักทรัพย์กลุ่มเงินทุน
และหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

หัตถยา บุญธรรม

วิทยานิพนธ์นี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กันยายน 2548

ISBN 974-9887-92-1

การวิเคราะห์ความเสี่ยงตามฤดูกาลของหลักทรัพย์กลุ่มเงินทุน
และหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

หัตถยา บุญธรรม

วิทยานิพนธ์นี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบวิทยานิพนธ์

.....ประธานกรรมการ

รศ. ดร. ประเสริฐ ไชยทิพย์

.....กรรมการ

ผศ. กาญจนา โชคถาวร

.....กรรมการ

ผศ. วีรวิ พฤทธิกันนท์

.....กรรมการ

รศ. ดร. วราภรณ์ ปัญญาวัตติ์

14 กันยายน 2548

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

วิทยานิพนธ์ฉบับนี้สำเร็จลงได้ด้วยความกรุณาจาก รศ.ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์ ประธานกรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์ ผู้ซึ่งกรุณาให้ความรู้ คำแนะนำ และคำปรึกษาที่เป็นประโยชน์ในการศึกษา ตลอดจนตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องจนวิทยานิพนธ์เสร็จสมบูรณ์ได้ด้วยดี ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงมา ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณกรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์ ผศ.กาญจนา ไชยถาวร ผศ.วัชรวิฑูรย์ กานนท์ และ รศ.ดร.วราภรณ์ ปัญญาดี ที่ได้กรุณาให้คำแนะนำที่เป็นประโยชน์และช่วยตรวจสอบข้อบกพร่องเพื่อให้วิทยานิพนธ์ฉบับนี้สมบูรณ์ยิ่งขึ้น

นอกจากนี้ ขอขอบคุณเจ้าหน้าที่คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ทุกท่านที่ให้ความช่วยเหลือติดต่อประสานงานด้านข้อมูล และเอกสารต่างๆ และขอขอบพระคุณเกษตรอำเภอและข้าราชการในสำนักงานเกษตรอำเภอบางกระพุ่มเป็นอย่างสูงที่อำนวยความสะดวกสำหรับการจัดทำวิทยานิพนธ์ฉบับนี้จนสำเร็จลุล่วง

ขอขอบคุณเพื่อนๆ นักศึกษาปริญญาโทคณะเศรษฐศาสตร์ที่ได้ให้ความช่วยเหลือ แนะนำ ตลอดจนเป็นกำลังใจอย่างดียิ่งในการทำวิทยานิพนธ์ฉบับนี้

ท้ายสุดนี้ ขอกราบขอบพระคุณคุณพ่อ คุณแม่และญาติพี่น้องทุกท่าน ที่ได้ให้โอกาสทางการศึกษาและเป็นกำลังใจที่ดีตลอดมาตลอดจนคณาจารย์ทุกท่านที่ได้ให้การอบรมสั่งสอน ผู้เขียนมาจนถึงทุกวันนี้ รวมถึงบุคคลทุกท่านที่มีได้กล่าวนาม ณ ที่นี้ โดยคุณประโยชน์ทั้งหมดที่เกิดจากวิทยานิพนธ์ฉบับนี้ ขอมอบแต่คุณพ่อและคุณแม่ ตลอดจนคณาจารย์ที่ได้ให้ความรู้แก่ผู้เขียน ส่วนข้อบกพร่องนั้น ผู้เขียนขออ้อมรับแต่เพียงผู้เดียว