

การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลกระทบต่อผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มที่เข้า
ใหม่ปี พ.ศ. 2546-2547 ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้
วิธีการถดถอยกำลังสองน้อยที่สุดที่ตัดแต่งค่าคลาดเคลื่อน

นางสาวรัชดา ต้นประเสริฐ

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
กุมภาพันธ์ 2549

ISBN 974-9889-97-5

การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลกระทบต่อผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มที่เข้า
ใหม่ปี พ.ศ. 2546-2547 ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้
วิธีการถดถอยกำลังสองน้อยที่สุดที่ตัดแต่งค่าคลาดเคลื่อน

นางสาวรัชดา ต้นประเสริฐ

วิทยานิพนธ์นี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กุมภาพันธ์ 2549

ISBN 974-9889-97-5

การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลกระทบต่อผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มที่เข้า
ใหม่ ปี พ.ศ. 2546-2547 ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้
วิธีการถดถอยกำลังสองน้อยที่สุดที่ตัดแต่งค่าคลาดเคลื่อน

รัชดา ต้นประเสริฐ

วิทยานิพนธ์นี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบวิทยานิพนธ์

.....ประธานกรรมการ

รศ.ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์

.....กรรมการ

รศ.ชเนศ ศรีวิชัยดำพันธ์

.....กรรมการ

รศ.กัญญา กุณทีกาญจน์

.....กรรมการ

รศ.ดร.วราภรณ์ ปัญญาวัตติ์

16 กุมภาพันธ์ 2549

©ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

วิทยานิพนธ์ฉบับนี้สำเร็จลุล่วงได้ด้วยความกรุณาอย่างยิ่งจาก รองศาสตราจารย์ ดร. ประเสริฐ ไชยทิพย์ ประธานกรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์ ผู้ซึ่งให้ความรู้ คำแนะนำ คำปรึกษา ตลอดจนให้ความช่วยเหลือและสละเวลาอันมีค่าในการตรวจทานแก้ไขข้อบกพร่องต่าง ๆ จนวิทยานิพนธ์ฉบับนี้เสร็จสมบูรณ์ ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ กาญจนา โชคถาวร และ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ วัชรวิทย์ พฤทธิกันนท์ กรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์ รวมถึง รองศาสตราจารย์ ธเนศ ศรีวิชัยล้ำพันธ์ รองศาสตราจารย์ กัญญา กุณทิกาญจน์ และรองศาสตราจารย์ ดร. วราภรณ์ ปัญญาวิจิตร กรรมการสอบวิทยานิพนธ์ ที่ได้กรุณาให้คำแนะนำและให้ความช่วยเหลือในการตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องต่าง ๆ จนวิทยานิพนธ์ฉบับนี้เสร็จสมบูรณ์

ขอขอบพระคุณเจ้าหน้าที่คณะเศรษฐศาสตร์ และเจ้าหน้าที่บรรณารักษ์ประจำห้องสมุดคณะเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ทุกท่าน ที่ให้ความอนุเคราะห์ช่วยเหลือในเรื่องเอกสาร การจัดทำบรรณานุกรม และคำแนะนำในเรื่องขั้นตอนการทำวิทยานิพนธ์จนสำเร็จลุล่วงด้วยดี

สุดท้ายนี้ขอขอบพระคุณ คุณพ่อประสาท คุณแม่สมบัติ ตันประเสริฐและทุกคนในครอบครัว ตลอดจนญาติผู้ใหญ่ทุกท่าน ที่ให้โอกาสทางการศึกษาและเป็นกำลังใจสำคัญจนประสบความสำเร็จ และขอขอบคุณ เพื่อน ๆ และน้อง ๆ ทุกคน ที่ช่วยให้กำลังใจ

หากวิทยานิพนธ์ฉบับนี้มีข้อผิดพลาดประการใด ผู้เขียนขออภัยเป็นอย่างสูงในข้อผิดพลาดนั้น และขอน้อมรับไว้แต่เพียงผู้เดียว