

การทดสอบแบบจำลองฟามาและเฟรนช์กับหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์  
ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย



จริญญา บาลสุข

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง  
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

สิงหาคม 2547

ISBN 974-980-614-X

การทดสอบแบบจำลองฟามาและเฟรนช์กับหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์  
ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

จริญญา บาลสุข

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา  
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

ประธานกรรมการ

.....  
ผศ.ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์

.....กรรมการ

.....  
ผศ.สุรกร วิศิษฐ์สุวรรณ

.....กรรมการ

.....  
ผศ.กาญจนา ไชยถาวร

27 สิงหาคม 2547

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

## กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้สำเร็จลุล่วงไปด้วยดีได้ด้วยความกรุณาจากผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์ ประธานกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระผู้ซึ่งให้ความรู้ คำแนะนำ คำปรึกษาและตรวจสอบแก้ไข จนการค้นคว้าแบบอิสระนี้สำเร็จลุล่วงไปด้วยดี ผู้เขียนขอกราบขอบคุณเป็นอย่างสูงมา ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ สุรภร วิศิษฎ์สุวรรณและผู้ช่วยศาสตราจารย์ กาญจนา ไชยถาวร กรรมการที่ปรึกษา ที่ได้กรุณาให้คำแนะนำที่เป็นประโยชน์ และตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องต่างๆ จนทำให้การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสร็จสมบูรณ์ยิ่งขึ้น

ขอกราบขอบพระคุณอาจารย์อาจารย์ชัยวัฒน์และอาจารย์กัญญา นิมมนุสสรณ์กุล ที่ได้กรุณาให้ความรู้ในการใช้โปรแกรมคอมพิวเตอร์ทางสถิติประกอบการวิเคราะห์การศึกษา ตลอดจนคำแนะนำและตรวจสอบแก้ไขตั้งแต่เริ่มค้นคว้าจนกระทั่งการค้นคว้าเสร็จสมบูรณ์ ขอขอบคุณบรรณารักษ์ ห้องสมุดคณะเศรษฐศาสตร์ เจ้าหน้าที่คณะเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัย เชียงใหม่ทุกท่านที่ช่วยอำนวยความสะดวกในด้านต่างๆเป็นอย่างดีและขอขอบคุณคุณสุสิทธิ์ทองที่ช่วยให้คำแนะนำในการค้นคว้าข้อมูล ตลอดจนพี่ๆธนาคารยูโอบี รัตนสิน จำกัด (มหาชน) ทุกท่านสำหรับกำลังใจที่ดีเสมอมา

ท้ายที่สุดขอขอบพระคุณ คุณพ่อและคุณแม่ ที่ได้ให้โอกาสทางการศึกษา ความรัก และกำลังใจด้วยดีเสมอมา สำหรับคุณความดีทั้งหมดที่เกิดจากการทำการค้นคว้าแบบอิสระนี้ ขอมอบแต่คุณพ่อ คุณแม่ และคณาจารย์ที่ได้ให้ความรู้แก่ผู้เขียน ส่วนข้อบกพร่องต่างๆผู้เขียน ขออ้อมรับแต่เพียงผู้เดียว

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
จริยญา บาลสุข

Copyright © by Chiang Mai University  
All rights reserved