

การประมาณค่าความผันผวนของผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในหมวด  
อาหารและเครื่องดื่มในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ปริยวัตร ยอดผ่านเมือง

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

บัณฑิตวิทยาลัย

All rights reserved

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

ตุลาคม 2554

การประมาณค่าความผันผวนของผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในหมวด  
อาหารและเครื่องดื่มในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ปริยวัตร ยอดผ่านเมือง

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง  
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

ตุลาคม 2554

การประมาณค่าความผันผวนของผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในหมวดอาหาร  
และเครื่องดื่มในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ปริยวัตร ยอดผ่านเมือง

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา  
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ

.....<sup>กฤษดา นิมอนุสรณ์กุล</sup>.....ประธานกรรมการ

.....<sup>อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิมอนุสรณ์กุล</sup>.....อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก

อ.ดร.กัญสุดา นิมอนุสรณ์กุล

อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิมอนุสรณ์กุล

.....<sup>อ.ดร.อนัสปรีย์ ไชยวรรณ</sup>.....กรรมการ

.....<sup>อ.ดร.อนัสปรีย์ ไชยวรรณ</sup>.....อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิมอนุสรณ์กุล

อ.ดร.อนัสปรีย์ ไชยวรรณ

.....<sup>อ.ดร.อนัสปรีย์ ไชยวรรณ</sup>.....กรรมการ

อ.ดร.อนัสปรีย์ ไชยวรรณ

.....<sup>รศ.ดร.เรียงชัย ต้นสุชาติ</sup>.....กรรมการ

รศ.ดร.เรียงชัย ต้นสุชาติ

5 ตุลาคม 2554

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

## กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ สำเร็จลุล่วงลงได้ด้วยดีด้วยความกรุณาจาก อาจารย์ ดร.ชัชวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์กุล ที่ได้ให้ความกรุณาตลอดเวลาเป็นประธานที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ ที่ได้ให้ความกรุณาชี้แนะ ให้คำปรึกษา และให้ความช่วยเหลือที่เป็นประโยชน์ในการปรับปรุงและแก้ปัญหา ตลอดจนตรวจสอบข้อบกพร่องต่างๆของการค้นคว้าแบบอิสระจนสามารถทำการค้นคว้าได้เสร็จสมบูรณ์ ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณอาจารย์ ดร.อนันต์ปรีช ไซวรรณ กรรมการการค้นคว้าแบบอิสระที่กรุณาให้คำแนะนำและข้อเสนอแนะที่เปี่ยมไปด้วยประโยชน์ และให้ความอนุเคราะห์ในการตรวจสอบข้อผิดพลาดต่างๆ เพื่อสนับสนุนให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สมบูรณ์ยิ่งขึ้น

ขอกราบขอบพระคุณคณาจารย์คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ทุกท่าน ที่ได้ประสิทธิประสาทวิชาความรู้ทางเศรษฐศาสตร์ให้แก่ผู้เขียน จนสามารถทำการค้นคว้าแบบอิสระได้เสร็จสมบูรณ์

ขอขอบพระคุณ เจ้าหน้าที่ประจำคณะเศรษฐศาสตร์ เจ้าหน้าที่และบรรณารักษ์ห้องสมุดคณะเศรษฐศาสตร์ เจ้าหน้าที่ประจำห้องศูนย์การเงิน และการลงทุน (Finance & Investment Center : F.I.C) ที่ช่วยเหลือให้คำแนะนำ รวมทั้งบริการ ประสานงานด้านต่างๆ เป็นอย่างดีตลอดระยะเวลาที่ผู้เขียนได้ทำการศึกษาในหลักสูตรนี้

ขอขอบคุณเพื่อนนักศึกษาคณะเศรษฐศาสตร์ ที่ได้ให้คำแนะนำและความช่วยเหลือ รวมถึงเป็นกำลังใจให้ข้าพเจ้า

ขอกราบขอบพระคุณบิดา มารดา และครอบครัวยอดผ่านเมือง ที่คอยเป็นกำลังใจและให้การสนับสนุนที่หาค่ามิได้เสมอมา

สุดท้ายนี้หากเกิดข้อผิดพลาดหรือข้อบกพร่องประการใด ผู้เขียนต้องขออภัยไว้ ณ ที่นี้ และขอน้อมรับแต่เพียงผู้เดียว ผู้เขียนคาดหวังเป็นอย่างยิ่งว่าการค้นคว้าแบบอิสระนี้จักเป็นประโยชน์แก่ผู้ที่สนใจศึกษาเกี่ยวกับการประมาณค่าความผันผวนของหลักทรัพย์

ปริยวัตร ยอดผ่านเมือง