

การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลกระทบต่อผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธุรกิจ  
การเกษตรในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยสมการถดถอย  
กำลังสองน้อยที่สุดที่ตัดแต่งค่าตลาดเคลื่อน

ฉัตรสุดา ดวงดาว

วิทยานิพนธ์นี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง  
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

บัณฑิตวิทยาลัย  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
พฤษภาคม 2548

ISBN 974-9885-86-4

การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลกระทบต่อผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธุรกิจ  
การเกษตรในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยสมการถดถอย  
กำลังสองน้อยที่สุดที่ตัดแต่งค่าตลาดเคลื่อน

ฉัตรสุดา ดวงดาว

วิทยานิพนธ์นี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา  
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบวิทยานิพนธ์

.....ประธานกรรมการ

ผศ. ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์

.....กรรมการ

ผศ. สุรภร วิเศษสุวรรณ

.....กรรมการ

ผศ. กาญจนา โชคถาวร

.....กรรมการ

รศ. ดร.วราภรณ์ ปัญญาวิดี

12 พฤษภาคม 2548

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

## กิตติกรรมประกาศ

วิทยานิพนธ์ฉบับนี้สำเร็จลุล่วงไปด้วยดีด้วยความกรุณาจากผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร. ประเสริฐ ไชยทิพย์ ประธานกรรมการสอบวิทยานิพนธ์ ผู้ซึ่งให้ความรู้ คำแนะนำปรึกษา ตลอดจนข้อคิดที่เป็นประโยชน์ในการศึกษา รวมทั้งกรุณาตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องจนวิทยานิพนธ์นี้สำเร็จได้ด้วยดี ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงมา ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณผู้ช่วยศาสตราจารย์ สุรภร วิศิษฐ์สุวรรณ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ กาญจนา ไชยถาวร และรองศาสตราจารย์ ดร. วราภรณ์ ปัญญาวดี กรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์ ที่ได้กรุณาให้คำแนะนำที่เป็นประโยชน์ และตรวจสอบข้อบกพร่องต่าง ๆ เพื่อให้วิทยานิพนธ์ฉบับนี้สมบูรณ์ยิ่งขึ้น

นอกจากนี้ขอขอบคุณเจ้าหน้าที่คณะเศรษฐศาสตร์ เจ้าหน้าที่ห้องสมุดคณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ทุกท่านที่ให้ความช่วยเหลือทางด้านเอกสารข้อมูล และการยืมหนังสือต่าง ๆ รวมทั้งขอขอบคุณเพื่อน ๆ นักศึกษาปริญญาโท ภาคปกติ ทุกท่านที่ได้ให้ความช่วยเหลือตลอดจนเป็นกำลังใจในการทำวิทยานิพนธ์ฉบับนี้เป็นอย่างดี

ท้ายที่สุดผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณ คุณพ่อเฉลย และคุณแม่ราตรี ดวงดาวที่ได้ให้โอกาสทางการศึกษาและเป็นกำลังใจด้วยดีเสมอมา ตลอดจนคณาจารย์ทุกท่านที่ได้ให้การอบรมสั่งสอนผู้เขียนมาจนถึงทุกวันนี้

คุณประโยชน์ทั้งหมดที่เกิดจากวิทยานิพนธ์ฉบับนี้ ขอมอบแด่บุพการี และผู้มีพระคุณทุกท่าน ส่วนข้อบกพร่องต่าง ๆ นั้นผู้เขียนขอน้อมรับไว้แต่เพียงผู้เดียว