

วิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลต่ออัตราผลตอบแทนของดัชนีตลาดหลักทรัพย์

กลุ่มการเงินในตลาดหลักทรัพย์อาเซียน

โดยวิวิพาเนลเออาร์ดีแอล

ศิริวรรณ วงศ์สีดา

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

บัณฑิตวิทยาลัย

Copyright © by Chiang Mai University

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

All rights reserved

พฤศจิกายน 2556

วิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลต่ออัตราผลตอบแทนของดัชนีตลาดหลักทรัพย์  
กลุ่มการเงินในตลาดหลักทรัพย์อาเซียน  
โดยวิวิพา แนนเออาร์ดีแอล

ศิริวรรณ วงศ์สีดา

วิทยานิพนธ์นี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง  
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

พฤศจิกายน 2556

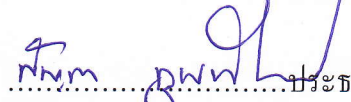
Copyright © by Chiang Mai University  
All rights reserved

วิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลต่ออัตราผลตอบแทนของดัชนีตลาดหลักทรัพย์  
กลุ่มการเงินในตลาดหลักทรัพย์อาเซียน  
โดยวิธีพหุคูณการถดถอย

ศิริวรรณ วงศ์สีดา

วิทยานิพนธ์นี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา  
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

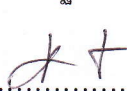
คณะกรรมการสอบวิทยานิพนธ์

 ประธานกรรมการ

รศ.กัญญา กุณทีกาญจน์

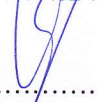
 กรรมการ

รศ.ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์

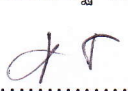
 กรรมการ

อ.ดร.ชูเกียรติ ชัยบุญศรี

คณะกรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์

 อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก

รศ.ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์

 อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

อ.ดร.ชูเกียรติ ชัยบุญศรี

28 พฤศจิกายน 2556

ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

## กิตติกรรมประกาศ

วิทยานิพนธ์นี้สำเร็จลงได้ด้วยความกรุณาของผู้ช่วยศาสตราจารย์ รศ.ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์ ประธานที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์ ที่ได้เสียสละเวลาในการให้ความรู้ คำแนะนำและคำปรึกษาที่มีประโยชน์ต่อการศึกษา อีกทั้งให้ความช่วยเหลือและให้การสนับสนุนในทุก ๆ ด้านอย่างดียิ่ง รวมถึงการตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องต่าง ๆ ซึ่งผู้เขียนขอขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้ และผู้เขียนขอขอบพระคุณ อาจารย์ ดร.ชูเกียรติ ชัยบุญศรี กรรมการวิทยานิพนธ์ ที่ได้ให้ข้อเสนอแนะที่มีคุณค่าต่อการศึกษา พร้อมทั้งตรวจสอบแก้ไขข้อผิดพลาดต่าง ๆ ที่เกิดขึ้น อันส่งผลให้วิทยานิพนธ์ฉบับนี้ดีสมบูรณ์มากยิ่งขึ้น

ขอขอบคุณเจ้าหน้าที่คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ ที่ได้ให้ความอนุเคราะห์ข้อมูลและให้คำแนะนำและความช่วยเหลือบริการประสานงานต่าง ๆ เป็นอย่างดีตลอดระยะเวลาที่ศึกษา

ขอขอบคุณ สิริพร กันนิเทศ และเพื่อนๆ นักศึกษาปริญญาโท คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ ที่ให้กำลังใจและสนับสนุนในการศึกษานี้จนสำเร็จได้สมบูรณ์

เหนือสิ่งอื่นใด ขอกราบขอบพระคุณ คุณพ่อวันชัย วงศ์สีดา และคุณแม่ทักษิณี วงศ์สีดา รวมถึงคุณสุภารัตน์ รอดสวัสดิ์ และคุณวาสนา เสียงล้ำ ผู้ที่ให้การดูแล สนับสนุนและเป็นกำลังใจที่สำคัญยิ่งในการศึกษามาทุกวันนี้

สุดท้ายนี้ หากวิทยานิพนธ์ฉบับนี้จะเป็นประโยชน์แก่หน่วยงานที่เกี่ยวข้อง ตลอดจนผู้สนใจข้อมูล สามารถใช้เป็นฐานข้อมูลในการวางแผนนโยบาย และกำหนดบทบาทหน้าที่ของภาครัฐ รวมทั้งผู้ลงทุนรายย่อย และผู้ลงทุนต่างชาติ สำหรับการวางแผนการลงทุน ผู้เขียนขอขอบความดีงามให้แก่ บิดา และมารดา ผู้ที่ให้การดูแล สนับสนุนและเป็นกำลังใจที่สำคัญยิ่งในการศึกษามาทุกวันนี้ ในส่วนของความผิดพลาดหรือข้อบกพร่องต่าง ๆ ผู้เขียนขอน้อมรับไว้เพียงผู้เดียว