

การวิเคราะห์อัตราส่วนต่อความเสี่ยงของดัชนีหลักทรัพย์เซ็ท 50
ด้วยวิธีควอนไทล์รีเกรสชัน

วิศรุต วังแหว

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กรกฎาคม 2557

Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

การวิเคราะห์อัตราส่วนต่อความเสี่ยงของดัชนีหลักทรัพย์เซต 50
ด้วยวิธีควอนไทล์รีเกรสชัน

วิศรุต วังแวง

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กรกฎาคม 2557

Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

การวิเคราะห์อัตราส่วนถ่วงความเสี่ยงของดัชนีหลักทรัพย์เซท 50
ด้วยวิธีควอนไทล์เรสชัน

วิศรุต วังเวว

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

กัณฑ์พร ช่างซัด ประธานกรรมการ

อ.ดร.กัณฑ์พร ช่างซัด

..... กรรมการ

อ.ดร.กัญญ์สุดา นิ่มอนุสรณ์กุล

..... กรรมการ

อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์กุล

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ

..... อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก

อ.ดร.กัญญ์สุดา นิ่มอนุสรณ์กุล

..... อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์กุล

1 กรกฎาคม 2557

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ สำเร็จลงได้ด้วยความกรุณาของ อาจารย์ ดร.กัญญ์สุดา นิ่มอนุสรณ์กุล ประธานกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ ซึ่งได้ให้คำปรึกษา คำชี้แนะที่เป็นประโยชน์ต่อการศึกษา ตลอดจนการตรวจทานแก้ไขข้อผิดพลาดต่างๆ อีกทั้งให้การสนับสนุนทุกๆด้านเป็นอย่างดีจนกระทั่งการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สำเร็จลุล่วงไปด้วยดี ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณ อาจารย์ ดร.กัณตพร ช่วงซิด ประธานกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ และอาจารย์ ดร.ชัชวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์กุล ที่ได้ให้ข้อเสนอแนะที่มีคุณค่าต่อการศึกษา พร้อมทั้งตรวจสอบข้อผิดพลาด ตลอดจนให้คำแนะนำต่างๆ อันส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ สมบูรณ์มากยิ่งขึ้น

ขอกราบขอบพระคุณคณาจารย์คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ทุกท่านที่ได้ให้ความรู้ตลอดจนแนวคิดในด้านต่างๆ และขอขอบคุณเจ้าหน้าที่ประจำคณะเศรษฐศาสตร์ทุกท่าน ที่ได้ให้คำแนะนำ ช่วยเหลือบริการประสานงานด้านต่างๆเป็นอย่างดีตลอดระยะเวลาที่ศึกษา

ขอกราบขอบพระคุณ บิดา มารดา และครอบครัวที่เป็นกำลังใจ และให้โอกาสทางการศึกษาเป็นอย่างดียิ่งเสมอมา ขอขอบคุณพี่น้องและเพื่อนๆ นักศึกษาปริญญาโทเศรษฐศาสตร์ (ภาคพิเศษ 1 ปี) ทุกคนที่ให้ความช่วยเหลือ คำปรึกษาและให้กำลังใจด้วยดีมาโดยตลอด

สุดท้ายนี้ผู้เขียนหวังว่าการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้จะเป็นประโยชน์สำหรับผู้ที่เกี่ยวข้องศึกษาการป้องกันความเสี่ยงของดัชนีหลักทรัพย์ SET 50 หากมีข้อผิดพลาดหรือข้อบกพร่องประการใด ผู้เขียนขอน้อมรับไว้เพียงผู้เดียวและขออภัยมา ณ ที่นี้ด้วย

วิศรุต วังแวง