

แบบจำลองความผันผวนของผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มเทคโนโลยี
สารสนเทศและการสื่อสาร ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
โดยวิธี อารีมาการซ์ อีการซ์ และทีการซ์

รศสุคนธ์ เรืองพิพัฒน์พันธุ์

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กันยายน 2551

แบบจำลองความผันผวนของผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มเทคโนโลยี
สารสนเทศและการสื่อสาร ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
โดยวิธี อารีมาการซ์ อีการซ์ และทีการซ์

รศสุคนธ์ เรืองพิพัฒนพันธุ์

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

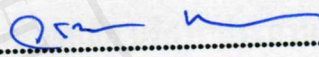
กันยายน 2551


แบบจำลองความผันผวนของผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มเทคโนโลยี
สารสนเทศและการสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
โดยวิธีอาร์มาร์ช อีการ์ช และทีการ์ช

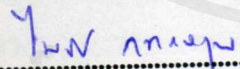
รศ.ดร.รุ่งเรือง พิพัฒน์พันธุ์


การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ


.....ประธานกรรมการ
รศ.ดร.วราภรณ์ ปัญญาวดี


.....กรรมการ
รศ.ดร.ศศิเพ็ญ พวงสายใจ


.....กรรมการ
ผศ.ดร.ไพรัช กาญจนการุณ


.....กรรมการ
รศ.ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์

19 กันยายน 2551

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สำเร็จลงด้วยดี โดยความกรุณาอย่างสูงจาก รองศาสตราจารย์ ดร. ศศิเพ็ญ พวงสายใจ ประธานที่ปรึกษา ที่ได้กรุณาเสียสละเวลาในการให้ความรู้ คำแนะนำ คำปรึกษา และตรวจทานแก้ไขจนการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้เสร็จสมบูรณ์ ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณ รองศาสตราจารย์ ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.ไพรัช กาญจนการุณ กรรมการการค้นคว้าแบบอิสระที่ได้ให้ความรู้ คำปรึกษาและข้อเสนอแนะที่มีคุณค่าต่อการศึกษา พร้อมทั้งแก้ไขข้อผิดพลาดต่างๆ ที่เกิดขึ้น อันส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ดีสมบูรณ์มากยิ่งขึ้น นอกจากนี้ผู้เขียนขอขอบพระคุณ รศ.ดร.วราภรณ์ ปัญญาวิดี ที่กรุณา รับเป็นประธานกรรมการตรวจสอบการค้นคว้าแบบอิสระ และให้คำแนะนำเป็นอย่างดีตลอดมา

ขอขอบพระคุณคณาจารย์คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ คณาจารย์รับเชิญทุกท่านที่ได้ให้ความรู้ด้านเศรษฐศาสตร์ ขอขอบคุณข้าราชการ เจ้าหน้าที่ และบรรณารักษ์ห้องสมุดคณะเศรษฐศาสตร์ ที่ได้ให้ความช่วยเหลือ บริการ ประสานงานด้านต่าง ๆ เป็นอย่างดีตลอดเวลาที่ศึกษา

ขอกราบขอบพระคุณ คุณพ่อ คุณแม่ และเครือญาติที่ได้ให้การดูแล สนับสนุน และเป็นกำลังใจแก่ผู้เขียนเสมอมา และขอกราบขอบพระคุณครูอาจารย์ทุกท่านที่ได้ประสิทธิ์ประสาทวิชาความรู้ตลอดจนให้ความช่วยเหลือและเมตตาแก่ผู้เขียนจนถึงทุกวันนี้

สุดท้ายนี้ หากมีสิ่งที่ขาดตกบกพร่อง หรือผิดพลาดประการใด ผู้เขียนกราบขออภัยไว้ ณ ที่นี้ด้วย และขออ้อมรับไว้เพียงผู้เดียว