

สารบัญ		หน้า
กิตติกรรมประกาศ		ก
บทคัดย่อภาษาไทย		ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ		ฉ
สารบัญตาราง		ญ
สารบัญภาพ		ฎ
บทที่ 1 บทนำ		
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา		1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา		4
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา		4
1.4 ขอบเขตการศึกษา		4
1.5 นิยามศัพท์		5
บทที่ 2 ทฤษฎีและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง		
2.1 ทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง		7
2.2 งานวิจัยที่เกี่ยวข้อง		18
บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย		
3.1 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา		23
3.2 วิธีวิจัย		23
บทที่ 4 ผลการศึกษา		
4.1 ผลการทดสอบความนึ่งของข้อมูล		29

4.2 การประมาณค่าความผันผวนจากแบบจำลองARMA-GARCH	31
4.3 ผลการทดสอบแบบจำลอง GRACH	31
4.4 ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูลความผันผวน	32
4.5 ผลการทดสอบความสัมพันธ์โดยวิธี OLS	33
4.6 การทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล	36
บทที่ 5 สรุปผลการศึกษาและข้อเสนอแนะ	
5.1 สรุปผลการศึกษา	38
5.2 ข้อเสนอแนะ	40
เอกสารอ้างอิง	41
ภาคผนวก	
ภาคผนวก ก ผลการทดสอบ Unit Root ของข้อมูลด้วย EViews 6	44
ภาคผนวก ข การประมาณค่าพารามิเตอร์จากแบบจำลองGARCHด้วย EViews 6	50
ภาคผนวก ค ผลการทดสอบ Unit Root ของข้อมูลความผันผวนด้วย EViews 6	51
ภาคผนวก ง ผลการประมาณค่าแบบวิธีOLS	54
ภาคผนวก จ ผลการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล	56
ประวัติผู้เขียน	57

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
4.1 ผลการทดสอบ unit root ณ ระดับ Level ของทั้ง 2 ข้อมูล	30
4.2 ผลการทดสอบ Lag p และ q ที่เหมาะสมสำหรับ แบบจำลอง ARMA-GARCH	31
4.3 ผลการทดสอบแบบจำลอง GARCH	31
4.4 ผลการทดสอบ unit root ณ ระดับ Level ข้อมูลความผันผวน	32
4.5 การประมาณค่าแบบวิธีกำลังสองน้อยสุด(OLS)	33
4.6 การประมาณค่าแบบวิธีกำลังสองน้อยสุด(OLS)	35
4.7 ผลการทดสอบ Granger Causality	37

รูป	สารบัญภาพ	หน้า
1.1	ดัชนีราคาปิดหุ้นกลุ่มพลังงานตั้งแต่ปี พ.ศ. 2536-2552	2

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved