

การพยากรณ์ความผันผวนของราคาน้ำมันดิบโลก
โดยวิธีกระบวนการความจำระยะยาว

ศุภฎี จิรรัตน์มงคล

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved
บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
มีนาคม 2555

การพยากรณ์ความผันผวนของราคาน้ำมันดิบโลก
โดยวิธีกระบวนการความจำระยะยาว

คุณวุฒิ จิรฉัตรมงคล

วิทยานิพนธ์นี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

มีนาคม 2555

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

การพยากรณ์ความผันผวนของราคาน้ำมันดิบโลก
โดยวิธีกระบวนการความจำระยะยาว

ดุษฎี จิรฉัตรมงคล

วิทยานิพนธ์นี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบวิทยานิพนธ์

.....ประธานกรรมการ

รศ.ชนรักษ์ เมฆขยาย

.....กรรมการ

อ.ดร.ชูเกียรติ ชัยบุญศรี

.....กรรมการ

อ.ดร.อนุภาค เสาร์เสาวภาคย์

.....กรรมการ

รศ.ดร.กาญจนา โชคถาวร

คณะกรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์

.....อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก

อ.ดร.ชูเกียรติ ชัยบุญศรี

.....อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

อ.ดร.อนุภาค เสาร์เสาวภาคย์

.....อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

รศ.ดร.กาญจนา โชคถาวร

ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

5 มีนาคม 2555

All rights reserved

©ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

วิทยานิพนธ์ฉบับนี้สำเร็จลุล่วงได้ด้วยความรู้และความอนุเคราะห์เป็นอย่างดียิ่งจากผู้มีพระคุณช่วยเหลือทุกท่าน โดยเฉพาะอย่างยิ่งจากอาจารย์ ดร.ชูเกียรติ ชัยบุญศรี ผู้เป็นอาจารย์ประธานที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์ฉบับนี้ ที่เสียสละเวลาอันมีค่ายิ่งเพื่อให้ความรู้ คำแนะนำ คำปรึกษา และเสนอแนวทางการแก้ปัญหาที่เกิดขึ้นระหว่างการทำงาน จนกระทั่งงานชิ้นนี้เสร็จสมบูรณ์ ผู้เขียนจึงใคร่ขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณคณะกรรมการผู้ดูแลงานวิทยานิพนธ์นี้ อันได้แก่ อาจารย์ ดร.อนุภาค เสาร์เสาวภาคย์ ที่ได้ให้ข้อเสนอแนะ ตรวจสอบข้อบกพร่องต่างๆ และดูแลความเรียบร้อยส่งผลให้วิทยานิพนธ์ฉบับนี้สมบูรณ์และเรียบร้อยมากยิ่งขึ้น

อีกทั้งผู้เขียนขอขอบพระคุณท่านรองศาสตราจารย์ ดร.กาญจนา โชคถาวร ที่ท่านได้ให้คำแนะนำดี ๆ และคอยดูแลให้ความช่วยเหลือสนับสนุนในทุก ๆ ด้านอย่างดียิ่งอันส่งผลให้วิทยานิพนธ์ฉบับนี้สำเร็จได้ด้วยดี

ขอกราบขอบพระคุณคณาจารย์ประจำคณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ทุกท่าน ที่ได้ประสิทธิ์ประสาทวิชาความรู้ให้แก่ผู้เขียน อีกทั้งขอขอบคุณเจ้าหน้าที่ประจำคณะเศรษฐศาสตร์ทุกท่านและเจ้าหน้าที่ประจำห้องศูนย์การเงินการลงทุน (Finance and Investment Center: FIC) มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ที่ให้ความดูแล ช่วยเหลือเป็นอย่างดีมาโดยตลอด

ขอขอบคุณทุกท่านที่ให้กำลังใจ สนับสนุน และเป็นแรงผลักดันให้วิทยานิพนธ์ฉบับนี้เสร็จสมบูรณ์ลงได้ โดยเฉพาะอย่างยิ่งจากครอบครัวจิรัตรมงคล และเพื่อนๆ ทุกคน

การศึกษาวิทยานิพนธ์ฉบับนี้ผู้เขียนหวังเป็นอย่างยิ่งว่าจะเป็นประโยชน์ต่อผู้ที่สนใจหรือหน่วยงานที่เกี่ยวข้องไม่มากนักน้อ

ท้ายที่สุดนี้หากมีสิ่งใดที่ผิดพลาดหรือขาดตกบกพร่องประการใด ผู้เขียนขออภัยเป็นอย่างสูง และขอน้อมรับในส่วนของความผิดพลาดหรือข้อบกพร่องนั้นไว้เพียงผู้เดียว

คุณหญิง จิรัตรมงคล