

การวิเคราะห์ความผันผวนของอัตราผลตอบแทนของ
ดัชนีราคาหลักทรัพย์ล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ไทย
สหรัฐอเมริกา ญี่ปุ่น และฮ่องกง

จุฑามาศ สุพรจักร

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

พฤษภาคม 2552

การวิเคราะห์ความผันผวนของอัตราผลตอบแทนของ

ดัชนีราคาหลักทรัพย์ล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ไทย
สหรัฐอเมริกา ญี่ปุ่น และฮ่องกง

จุฑามาศ สุพรจักร

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

พฤษภาคม 2552

การวิเคราะห์ความผันผวนของอัตราผลตอบแทนของ

การวิเคราะห์ความผันผวนของอัตราผลตอบแทนของ
ดัชนีราคาหลักทรัพย์ล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ไทย
สหรัฐอเมริกา ญี่ปุ่น และฮ่องกง

จุฬามาศ สุพรจักร

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ



ประธานกรรมการ

อ.ดร.สังกม สุวรรณรัตน์



กรรมการ

ผศ.ดร.นิสิต พันมิตร



กรรมการ

ผศ.ดร.ไพรัช กาญจนการุณ

12 พฤษภาคม 2552

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ สำเร็จขึ้นได้ด้วยความกรุณาเป็นอย่างยิ่งจากผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.นิสิต พันธมิตร ที่ได้สละเวลาอันมีค่าให้ความรู้ คำแนะนำ และคำปรึกษาอันเป็นประโยชน์ยิ่งต่อการวิเคราะห์และสรุปผลการศึกษา และขอขอบพระคุณ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.ไพรัช กาญจนการุณ ได้กรุณาสละเวลาอันมีค่าที่กรุณาให้คำแนะนำและตรวจทาน อันเป็นประโยชน์ต่อการปรับปรุงแก้ไข อันส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สำเร็จได้ด้วยดี และเป็นผลงานที่มีคุณภาพ

ขอขอบพระคุณท่านอาจารย์ คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ เจ้าหน้าที่ประจำคณะเศรษฐศาสตร์ทุกท่านที่ให้ความดูแล ช่วยเหลือมาตลอดหลักสูตรการศึกษา ขอขอบพระคุณผู้ให้ข้อมูลทุกท่านที่มีอาภักถ์นามได้หมด ณ ที่นี้ ขอขอบคุณแรงสนับสนุน กำลังใจ ตลอดจนความช่วยเหลือในด้านต่างๆ จากเพื่อนๆ ร่วมรุ่นทุกท่าน

ท้ายที่สุดนี้ ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณ คุณแม่ พี่ และน้อง ที่คอยให้กำลังใจในการศึกษาเสมอมา หากมีข้อผิดพลาดประการใดผู้เขียนขอน้อมรับไว้แต่ผู้เดียว และผู้เขียนหวังว่าการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้จะมีประโยชน์ต่อผู้ที่มีความสนใจไม่มากนักน้อย

จุฑามาศ สุพรจักร