

การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์ราคาทองคำระหว่าง
แบบจำลองอาร์มา การ์ชเอ็ม อีการ์ชและจีเออาร์

दनयरदनं कनररकष

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กันยายน 2552

การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์ราคาทองคำระหว่าง
แบบจำลองอาร์มา การ์ชเอ็ม อีการ์ชและจีเจอาร์

ศันย์รัตน์ คณารักษ์

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
กันยายน 2552


การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์ราคาทองคำระหว่างแบบจำลอง

อาร์มา การ์ชเอ็ม อีการ์ชและจีเจอาร์

คณัรต์น คณาร์กษ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต


คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ


.....ประธานกรรมการ

อ.ดร.ประพัฒน์นม จริยะพันธุ์


.....กรรมการ

ผศ.ดร.อัญชลี เจ็งเจริญ


.....กรรมการ

รศ.ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์


.....กรรมการ

รศ.ดร.ชเนต ศรีวิชช์อำพันธ์

8 กันยายน 2552

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ สำเร็จลงได้ด้วยดี โดยได้รับความกรุณาเป็นอย่างยิ่งจาก รศ.ดร. ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ ที่ได้ให้ความกรุณาสละเวลารับเป็นประธานที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ ซึ่งได้ให้คำแนะนำถึงประเด็นต่างๆ ในการศึกษาและชี้แนวทางในการแก้ปัญหา อันเป็นประโยชน์ในการวิเคราะห์และสรุปผลการศึกษา รวมทั้งการแก้ไขงานให้สมบูรณ์ยิ่งขึ้น นอกจากนี้ ผู้เขียนขอขอบพระคุณ อ.ดร.ประพัฒน์ นิมสกูล จริยะพันธ์ ผศ.ดร.อัญชติ เจ็งเจริญ และ รศ.ดร.ชเนศ ศรีวิชัยคำพันธ์ ที่ได้กรุณาสละเวลาอันมีค่ารับเป็นกรรมการการค้นคว้าแบบอิสระ โดยได้ให้ข้อเสนอแนะที่มีคุณค่าต่อการศึกษา พร้อมทั้งตรวจสอบแก้ไขข้อผิดพลาดต่างๆ อันส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สำเร็จลงด้วยดีและเป็นผลงานที่มีคุณภาพ เป็นความภาคภูมิใจของผู้เขียนเป็นอย่างยิ่ง

ขอขอบพระคุณ อ.ชัยวัฒน์ นิมสกูล ที่ได้กรุณาสละเวลาอันมีค่าในการให้ความรู้ คำแนะนำ และคำปรึกษา ตลอดจนชี้แนะแนวทางในการค้นคว้าและตรวจสอบแก้ไขปรับปรุงด้วยความเมตตาเสมอมา ขอขอบพระคุณอาจารย์ทุกท่านเป็นอย่างสูงที่ได้ประสิทธิ์ประสาทความรู้อันเป็นรากฐานที่สำคัญในการประกอบอาชีพในภายภาคหน้า โดยเฉพาะอย่างยิ่งความรู้ทางด้านเศรษฐศาสตร์ที่ผู้เขียนจักได้นำไปสร้างคุณประโยชน์แก่ประเทศชาติต่อไป

ขอขอบคุณเจ้าหน้าที่ประจำคณะเศรษฐศาสตร์ทุกท่าน ที่ให้ความดูแลและช่วยเหลือข้าพเจ้ามาตลอดหลักสูตรการศึกษา ขอขอบคุณห้องสมุดต่างๆ ซึ่งเป็นแหล่งค้นคว้าข้อมูลที่สำคัญในการเรียนและการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ ขอขอบคุณผู้ให้ข้อมูลทุกท่านที่มีอาจกล่าวนามได้หมด ณ ที่นี้ ขอขอบคุณแรงสนับสนุนและกำลังใจที่ได้รับจากครอบครัวตลอดจนเพื่อนๆ จนทำให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้เสร็จสมบูรณ์ลงได้

ท้ายที่สุดนี้ หากมีข้อผิดพลาดประการใด ผู้เขียนขอน้อมรับไว้แต่เพียงผู้เดียว และผู้เขียนหวังว่าการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ จะมีประโยชน์ต่อผู้ลงทุนและหน่วยงานที่เกี่ยวข้องได้ใช้ในการกำหนดนโยบายและวางแผนการลงทุนต่อไป