

การจำลองแบบการประเมินราคาสินทรัพย์ประเภททุนที่ผันแปรไปตามเวลา
กรณีศึกษากลุ่มธนาคารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

นาราลิน วงศ์เรือง

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
All rights reserved
สิงหาคม 2553

การจำลองแบบการประเมินราคาสินทรัพย์ประเภททุนที่ผันแปรไปตามเวลา
กรณีศึกษากลุ่มธนาคารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

นาราดิน วงศ์เรือง

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

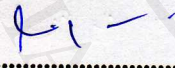
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved
บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
สิงหาคม 2553

การจำลองแบบการประเมินราคาสินทรัพย์ประเภททุนที่ผันแปรไปตามเวลา
กรณีศึกษากลุ่มธนาคารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

นาราลิน วงศ์เรือง

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ


.....ประธานกรรมการ

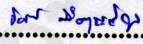
รศ.อารีย์ เชื้อเมืองพาน


.....กรรมการ

รศ.ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์



.....กรรมการ

อ.ดร.พทย์รัตน์ ภาสาน์พิพัฒนกุล

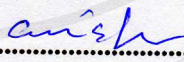

.....กรรมการ

อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิมอนุสรณ์กุล

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ


.....อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก

รศ.ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์


.....อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

อ.ดร.พทย์รัตน์ ภาสาน์พิพัฒนกุล


.....อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิมอนุสรณ์กุล

31 สิงหาคม 2553

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ สำเร็จลุล่วงลงได้ด้วยความกรุณาและความอนุเคราะห์อย่างสูงจาก รศ.ดร. ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ ประธานกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระนี้ ที่ได้กรุณาเสียสละเวลาในการให้ความรู้ คำแนะนำ และคำปรึกษาที่เป็นประโยชน์ต่อการศึกษา จนกระทั่งการค้นคว้าแบบอิสระนี้เสร็จสมบูรณ์ ซึ่งผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอขอบพระคุณ รศ.อารีย์ เชื้อเมืองพาน ประธานกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ และ อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิมนุสสรณ์กุล อ.ดร.พทัยรัตน์ ภาสกรพิพัฒน์กุล ที่กรุณาารับเป็นกรรมการตรวจสอบการค้นคว้าแบบอิสระ และให้ข้อเสนอแนะที่มีคุณค่าต่อการศึกษา พร้อมทั้งตรวจสอบข้อผิดพลาดต่างๆ อันส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สมบูรณ์มากยิ่งขึ้น

ขอบพระคุณ ดร.ชูเกียรติ ชัย บุญศรี และ อ.ดร.อนันต์ปรีดิ์ ไชยวรรณ ที่ได้ให้ความรู้และช่วยเหลือด้านต่างๆจนการค้นคว้าแบบอิสระครั้งนี้สำเร็จลุล่วงลงได้ ขอบพระคุณคณาจารย์คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ ที่ได้ให้ความรู้ด้านเศรษฐศาสตร์ ขอบคุณข้าราชการ เจ้าหน้าที่ ตลอดจนบรรณารักษ์ห้องสมุดของคณะเศรษฐศาสตร์ ที่ได้คำแนะนำช่วยเหลือ บริการประสานงาน และอำนวยความสะดวกต่างๆ เป็นอย่างดีตลอดระยะเวลาที่ศึกษา

ขอกราบขอบพระคุณอย่างสูงต่อ บิดา มารดา และครอบครัวที่คอยสนับสนุน ให้กำลังใจ และให้โอกาสทางการศึกษาเป็นอย่างดียิ่งเสมอมา

ขอบคุณเพื่อนๆ นักศึกษาปริญญาโทเศรษฐศาสตร์ หลักสูตร 1 ปี รุ่นที่ 8 ที่คอยให้กำลังใจ และสนับสนุนในการศึกษาครั้งนี้จนสำเร็จได้สมบูรณ์

สุดท้ายนี้หากการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้จะเป็นประโยชน์แก่หน่วยงานที่เกี่ยวข้อง ตลอดจนผู้สนใจข้อมูล ผู้เขียนขอมอบความดีงามให้แก่คุณพ่อ คุณแม่ พี่ชาย พี่สาว และ อ.ดร.ภักดี เจริญสวรรค์ ผู้ที่ให้การดูแลและเป็นกำลังใจที่สำคัญยิ่งในการศึกษาครั้งนี้ ในส่วนของความผิดพลาดหรือข้อบกพร่องประการใด ผู้เขียนขออภัยมา ณ โอกาสนี้