

การวิเคราะห์ความผันผวนของอัตราผลตอบแทนของดัชนีราคาหลักทรัพย์
ในตลาดหลักทรัพย์ไทย สิงคโปร์ มาเลเซีย
อินโดนีเซีย และฟิลิปปินส์



นาริน ผลใสว

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

ตุลาคม 2550

การวิเคราะห์ความผันผวนของอัตราผลตอบแทนของดัชนีราคาหลักทรัพย์
ในตลาดหลักทรัพย์ไทย สิงคโปร์ มาเลเซีย
อินโดนีเซีย และฟิลิปปินส์

นาริน ผลไสว

วิทยานิพนธ์นี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

ตุลาคม 2550

การวิเคราะห์ความผันผวนของอัตราผลตอบแทนของดัชนีราคาหลักทรัพย์
ในตลาดหลักทรัพย์ไทย สิงคโปร์ มาเลเซีย
อินโดนีเซีย และฟิลิปปินส์

นารีณ ผลไสว

วิทยานิพนธ์นี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบวิทยานิพนธ์

ประธานกรรมการ

รศ.ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์

กรรมการ

รศ.กาญจนา โชคฉาว

กรรมการ

อ.ดร.เยาวเรศ เขาวนพูนผล

กรรมการ

รศ.อารีย์ เชื้อเมืองพาน

1 ตุลาคม 2550

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

กิตติกรรมประกาศ

วิทยานิพนธ์ฉบับนี้สำเร็จลงได้ด้วยดี โดยได้รับความกรุณาเป็นอย่างยิ่งจากท่านรองศาสตราจารย์ ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ ที่ได้สละเวลาอันมีค่าในการให้ความรู้ คำแนะนำ และคำปรึกษาอันเป็นประโยชน์ยิ่งต่อการวิเคราะห์และสรุปผลการศึกษา นอกจากนี้ผู้เขียนขอขอบพระคุณ รองศาสตราจารย์กาญจนา โชคถาวร และอาจารย์ ดร.เยาวเรศ เขาวนพูนผล ได้กรุณาสละเวลาอันมีค่ารับเป็นกรรมการสอบวิทยานิพนธ์ โดยได้ให้ข้อเสนอแนะที่มีคุณค่าต่อการศึกษา พร้อมทั้งตรวจสอบแก้ไขข้อผิดพลาดต่างๆ อันส่งผลให้วิทยานิพนธ์ฉบับนี้สำเร็จได้ด้วยดี และเป็นผลงานที่มีคุณภาพ

ขอขอบพระคุณคณาจารย์ คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ เจ้าหน้าที่ประจำคณะเศรษฐศาสตร์ทุกท่านที่ให้ความดูแล ช่วยเหลือมาตลอดหลักสูตรการศึกษา ขอขอบคุณผู้ให้ข้อมูลทุกท่านที่มีอาจกล่าวนามได้หมด ณ ที่นี้ ขอขอบคุณแรงสนับสนุนและกำลังใจที่ได้รับจากเพื่อนๆ นักศึกษาปริญญาโท สาขาวิชา เศรษฐศาสตร์ หลักสูตรสองภาษา และหลักสูตรภาคพิเศษ 1 ปี จนทำให้วิทยานิพนธ์ฉบับนี้เสร็จสมบูรณ์ลงได้

ท้ายที่สุดนี้ ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณ คุณพ่อ คุณแม่ และพี่ ที่คอยให้กำลังใจในการศึกษาเสมอมา หากมีข้อผิดพลาดประการใดผู้เขียนขออภัยไว้แต่ผู้เดียว และผู้เขียนหวังว่าการวิทยานิพนธ์ฉบับนี้จะมีประโยชน์ต่อผู้ที่มีความสนใจไม่มากนักน้อย