

แบบจำลองความผันผวนของผลตอบแทนของหลักทรัพย์
บางหลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุก่อสร้าง และตกแต่งของ
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธี
อาร์มีการ์ช อีการ์ช และ ทีการ์ช

ณัฐกานต์ ไกรสร

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

สิงหาคม 2551

แบบจำลองความผันผวนของผลตอบแทนของหลักทรัพย์
บางหลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุก่อสร้าง และตกแต่งของ
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธี
อาร์มีการ์ช อีการ์ช และ ทีการ์ช

ณัฐกานต์ ไกรสร

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

สิงหาคม 2551

แบบจำลองความผันผวนของผลตอบแทนของหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุ
ก่อสร้าง และตกแต่งของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธี
อาร์มีการ์ช อีการ์ช และทีการ์ช

ณัฐกานต์ ไกรสร

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ



ประธานกรรมการ

รศ.ดร.วราภรณ์ ปัญญาวัตติ์



กรรมการ

รศ.ดร.ศศิเพ็ญ พวงสายใจ

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่



กรรมการ

Copyright ©

All rights reserved



กรรมการ

รศ.ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์

25 สิงหาคม 2551

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ สำเร็จลงได้ด้วยความช่วยเหลือของรศ.ดร.ศศิเพ็ญ พวงสายใจ ประธานกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ ที่ได้เสียสละเวลาในการให้ความรู้ คำแนะนำและคำปรึกษาที่มีประโยชน์ต่อการศึกษา อีกทั้งให้ความช่วยเหลือและให้การสนับสนุนในทุก ๆ ด้านอย่างดียิ่ง รวมถึงการตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องต่าง ๆ ซึ่งผู้เขียนขอขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้ และขอขอบพระคุณ ผศ.ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และผศ.ดร.ไพรัช กาญจนการุณ กรรมการการค้นคว้าแบบอิสระที่ได้ให้ข้อเสนอแนะที่มีคุณค่าต่อการศึกษา พร้อมทั้งตรวจสอบแก้ไขข้อผิดพลาดต่างๆที่เกิดขึ้น อันส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ดีสมบูรณ์มากยิ่งขึ้น

ขอขอบพระคุณคณาจารย์คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ คณาจารย์รับเชิญทุกท่าน ที่ได้ประสิทธิ์ประสาทวิชาเศรษฐศาสตร์ ขอขอบคุณข้าราชการ เจ้าหน้าที่ ตลอดจนบรรณารักษ์ ห้องสมุดของคณะเศรษฐศาสตร์ และเจ้าหน้าที่ศูนย์การเงินและการลงทุน ที่ให้คำแนะนำช่วยเหลือบริการประสานงานด้านต่างๆเป็นอย่างดีตลอดระยะเวลาที่ศึกษา และขอบคุณพี่ๆเพื่อนๆนักศึกษาปริญญาโทเศรษฐศาสตร์ หลักสูตร 1 ปีรุ่น 6 ที่ให้ความช่วยเหลือ คำแนะนำในการทำการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้

สุดท้ายนี้หากการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้จะเป็นประโยชน์แก่หน่วยงานที่เกี่ยวข้อง ตลอดจนผู้สนใจข้อมูล ผู้เขียนขอมอบความดีงามให้แก่ คุณพ่อ คุณแม่ และญาติพี่น้อง ผู้ที่ให้การดูแลและเป็นกำลังใจเสมอมา รวมทั้งเป็นแรงผลักดันให้ประสบความสำเร็จการศึกษาในครั้งนี้ ในส่วนของความผิดพลาดหรือข้อบกพร่องต่าง ๆ ผู้เขียนขอน้อมรับไว้เพียงผู้เดียว