

การวิเคราะห์ความผันผวนของอัตราผลตอบแทนของตลาดหลักทรัพย์
แห่งประเทศไทยโดยใช้แบบจำลองระบบความจำระยะยาว



เขมรรัฐ ชัยมงคล

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

มีนาคม 2553

การวิเคราะห์ความผันผวนของอัตราผลตอบแทนของตลาดหลักทรัพย์
แห่งประเทศไทยโดยใช้แบบจำลองระบบความจำระยะยาว



วิทยานิพนธ์นี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

มีนาคม 2553



การวิเคราะห์ความผันผวนของอัตราผลตอบแทนของตลาดหลักทรัพย์
แห่งประเทศไทยโดยใช้แบบจำลองระบบความจำระยะยาว

เขมรัฐ ชัยมงคล

วิทยานิพนธ์นี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบวิทยานิพนธ์

.....ประธานกรรมการ

อ. ดร. ประพัฒน์ นม จริยะพันธุ์

.....กรรมการ

รศ. ดร. ทารงศักดิ์ ศรีบุญเลิศ

.....กรรมการ

ผศ. ดร. ไพรัช กาญจนการณ

.....กรรมการ

รศ. อาทิตย์ เชื้อเมืองพาน

2 มีนาคม 2553

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

กิตติกรรมประกาศ

วิทยานิพนธ์ฉบับนี้สำเร็จลงได้ด้วยความกรุณาของอาจารย์ ดร. ประพัฒน์ชนม์ จริยะพันธุ์ ประธานกรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์ ผู้ซึ่งให้ความรู้ คำแนะนำ คำปรึกษาที่มีประโยชน์ ตลอดจนให้ความช่วยเหลือและสละเวลาอันมีค่าในการสนับสนุนในทุก ๆ ด้านเป็นอย่างดีโดยเฉพาะการตรวจทานแก้ไขข้อบกพร่องต่าง ๆ จนวิทยานิพนธ์ฉบับนี้สำเร็จลุล่วงไปได้ด้วยดี ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณอาจารย์เป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้ รวมถึง รองศาสตราจารย์ ดร. ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร. ไพรัช กาญจนการุณ กรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์ ที่ได้ให้คำแนะนำที่มีคุณค่าและความช่วยเหลือในการตรวจสอบแก้ไขข้อผิดพลาดต่าง ๆ และ รองศาสตราจารย์ อารีย์ เชื้อเมืองพาน กรรมการผู้ทรงคุณวุฒิ ผู้ให้การสนับสนุนและอนุเคราะห์งานวิทยานิพนธ์ฉบับนี้เสร็จสมบูรณ์

ขอกราบขอบพระคุณอาจารย์ ดร. อนันตปริย ไชยวรรณ ที่ได้ให้คำแนะนำในการประมวลผลข้อมูลและคุณอาจารย์คณะเศรษฐศาสตร์ทุกท่านที่ประสิทธิ์ประสาทความรู้ให้ผู้เขียนตลอดการศึกษา ขอขอบพระคุณ คุณอารี หน่อเรือน เจ้าหน้าที่บริการการศึกษา ที่ช่วยเหลือให้คำปรึกษาและอำนวยความสะดวกในการประสานงานต่าง ๆ เป็นอย่างดี

สุดท้ายนี้หากแม้วิทยานิพนธ์ฉบับนี้เป็นประโยชน์บ้างไม่มากก็น้อยแก่ผู้หนึ่งผู้ใด ผู้เขียนขอมอบความดีงามให้แก่บิดา มารดา ผู้ซึ่งให้กำลังใจและสนับสนุนการศึกษาตลอดมา หากมีข้อผิดพลาดประการใดผู้เขียนขออภัยและน้อมรับความผิดพลานั้นแต่เพียงผู้เดียว

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ เขมรัฐ ชัยมงคล
 Copyright© by Chiang Mai University
 All rights reserved