

แบบจำลองการพยากรณ์ดัชนีตลาดหลักทรัพย์  
ในกลุ่มประเทศเอเชียตะวันออกเฉียงใต้

ปาริฉัตร ทองคำ

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
Copyright © by Chiang Mai University  
All rights reserved  
บัณฑิตวิทยาลัย  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
กุมภาพันธ์ 2555

แบบจำลองการพยากรณ์ดัชนีตลาดหลักทรัพย์  
ในกลุ่มประเทศเอเชียตะวันออกเฉียงใต้

ปาริฉัตร ทองคำ

วิทยานิพนธ์นี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง  
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กุมภาพันธ์ 2555

แบบจำลองการพยากรณ์ดัชนีตลาดหลักทรัพย์  
ในกลุ่มประเทศเอเชียตะวันออกเฉียงใต้

ปาริฉัตร ทองคำ

วิทยานิพนธ์นี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา  
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบวิทยานิพนธ์

.....ประธานกรรมการ

รศ.ชนรัช เมฆขยาย

.....กรรมการ

รศ.ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์

.....กรรมการ

อ.ดร.ชฎเกียรติ ชัยบุญศรี

.....กรรมการ

อ.ดร.อนุภาค เสาร์เสาวภาคย์

คณะกรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์

.....อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก

รศ.ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์

.....อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

อ.ดร.ชฎเกียรติ ชัยบุญศรี

.....อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

อ.ดร.อนุภาค เสาร์เสาวภาคย์

16 กุมภาพันธ์ 2555

©ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

## กิตติกรรมประกาศ

วิทยานิพนธ์ฉบับนี้สำเร็จลุล่วงได้ด้วยความกรุณาและความอนุเคราะห์จากคณาจารย์และผู้มีพระคุณหลายท่าน โดยเฉพาะอย่างยิ่ง รศ.ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์ ประธานที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์ที่ได้สละเวลาอันมีค่าในการให้ความรู้ คำแนะนำ ตลอดจนช่วยตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องต่างๆ ของวิทยานิพนธ์ฉบับนี้ให้มีความถูกต้องสมบูรณ์ตลอดระยะเวลาที่ทำการวิจัย ผู้วิจัยจึงขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณ อ.ดร.ชูเกียรติ ชัยบุญศรี ที่ได้สละเวลาในการให้ความรู้ คำแนะนำเกี่ยวกับทฤษฎีที่ใช้ในการวิจัย ตลอดจนโปรแกรมการวิเคราะห์ข้อมูลทางเศรษฐมิติ อันเป็นประโยชน์ต่อการวิเคราะห์และสรุปผลการศึกษา

ขอกราบขอบพระคุณ อ.ดร.อนุภาค เสาร์เสาวภาคย์ ที่ได้สละเวลาในการให้ความรู้ คำแนะนำเกี่ยวกับขั้นตอน และระเบียบวิธีในการจัดทำวิทยานิพนธ์ รวมทั้งช่วยตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องทางด้านภาษาของวิทยานิพนธ์ฉบับนี้ให้มีความสอดคล้องและถูกต้องสมบูรณ์โดยตลอด

ขอกราบขอบพระคุณ รศ.ธนรักษ์ เมฆขยาย อาจารย์ประจำคณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยแม่โจ้ ที่ได้สละเวลามาเป็นประธานสอบวิทยานิพนธ์ และให้คำแนะนำที่เป็นประโยชน์ต่อการปรับปรุงวิทยานิพนธ์ให้มีความสมบูรณ์ยิ่งขึ้น

ขอกราบขอบพระคุณคณาจารย์ประจำคณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ทุกท่าน ที่ได้ประสิทธิ์ประสาทวิชาความรู้ด้วยความเอาใจใส่และความเมตตาตลอดมา และขอขอบคุณเจ้าหน้าที่ประจำคณะเศรษฐศาสตร์ที่ให้ความดูแลช่วยเหลือและประสานงานตลอดหลักสูตรการศึกษา

ท้ายที่สุดนี้ขอกราบขอบพระคุณ บิดา-มารดา นายประดิษฐ์-นางฉันทนา ทองคำ ที่ช่วยตรวจสอบแก้ไขผลงานวิจัยในด้านภาษา ให้การสนับสนุน และให้กำลังใจแก่ผู้วิจัยมาโดยตลอด รวมทั้งเพื่อน ๆ ทุกคนที่มีส่วนในการให้ความช่วยเหลือและผลักดันให้งานวิจัยฉบับนี้สำเร็จได้ด้วยดี สุดท้ายนี้ผู้วิจัยหวังว่าวิทยานิพนธ์ฉบับนี้จะเป็นประโยชน์ต่อผู้สนใจ และหากมีข้อบกพร่องประการใดผู้วิจัยต้องขออภัยไว้ ณ ที่นี้

ปรีฉัตร ทองคำ