

การวิเคราะห์ทางเทคนิคของแบบจำลองความผันผวนของผลตอบแทน
ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกลุ่ม 50 หลักทรัพย์
โดยแบบจำลองการชเือกซ์



อัครัช จงจำเนียร

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
ธันวาคม 2552

การวิเคราะห์ทางเทคนิคของแบบจำลองความผันผวนของผลตอบแทน
ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกลุ่ม 50 หลักทรัพย์
โดยแบบจำลองการช้อเอ็กซ์

อัครัช จงจำเนียร

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
ธันวาคม 2552

การวิเคราะห์ทางเทคนิคของแบบจำลองความผันผวนของผลตอบแทน
ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกลุ่ม 50 หลักทรัพย์

โดยแบบจำลองการชเง็ช

อัครช จงจำเนียร

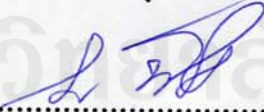
การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ



ประธานกรรมการ

อ.ดร.สังคม สุวรรณรัตน์



กรรมการ

ผศ.ดร.นิสิต พันมิตร



กรรมการ

อ.ดร.ประพัฒน์ จริยะพันธุ์

22 ธันวาคม 2552

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้สำเร็จลงได้ด้วยความกรุณาของ ผู้ช่วยศาสตราจารย์นิสิต พันธมิตร ประธานที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระที่ได้เสียสละเวลาในการให้ความรู้ คำแนะนำและคำปรึกษา ที่มีประโยชน์ต่อการศึกษา อีกทั้งให้ความช่วยเหลือและให้การสนับสนุนในทุกๆด้านอย่างดียิ่ง รวมถึงการตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องต่างๆ ซึ่งผู้เขียนขอขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ประพัฒน์ จริยะพันธุ์ กรรมการการค้นคว้าแบบอิสระ และอาจารย์ ดร.สังคม สุวรรณรัตน์ ได้ให้ข้อเสนอแนะที่มีคุณค่าต่อการศึกษา พร้อมทั้งตรวจสอบแก้ไขข้อผิดพลาดต่างๆ ที่เกิดขึ้น อันส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ดีสมบูรณ์มากยิ่งขึ้น ขอขอบพระคุณอาจารย์ ดร.ศัทธาธิปไตย ภาสกรพิพัฒน์กุล ได้สละเวลาในการให้ความรู้ทั้งคำแนะนำด้านเศรษฐกิจ และความรู้ ในด้านเทคนิคที่จำเป็นแก่ผู้เขียนเสมอ

ขอขอบพระคุณคณาจารย์คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ คณาจารย์รับเชิญ ทุกท่านที่ได้ให้ความรู้ด้านเศรษฐศาสตร์ ขอขอบคุณข้าราชการ เจ้าหน้าที่ตลอดจนบรรณารักษ์ ห้องสมุดของคณะเศรษฐศาสตร์ที่ให้คำแนะนำช่วยเหลือบริการประสานงานด้านต่างๆ เป็นอย่างดี ตลอดระยะเวลาที่ศึกษา

ขอขอบคุณ คุณศิริกาญจน์ จงจำเนียร ภรรยา และน้องแพรว บุตรที่เป็นกำลังใจคอยดูแล อำนวยความสะดวกสิ่งจำเป็นตลอดการศึกษาของผู้เขียน

สุดท้ายนี้หากการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้จะเป็นประโยชน์แก่หน่วยงานที่เกี่ยวข้อง ตลอดจนผู้สนใจข้อมูล ผู้เขียนขอมอบความดีงามให้แก่ คุณพ่อประยูร จงจำเนียร และ คุณแม่วรนุช จงจำเนียร ผู้ที่ให้การอบรมดูแลและเป็นกำลังใจที่สำคัญยิ่งในการศึกษามาจนทุกวันนี้ ในส่วนของ ความผิดพลาดหรือข้อบกพร่องต่างๆผู้เขียนขอน้อมรับไว้เพียงผู้เดียว

อักรัช จงจำเนียร