

ชื่อเรื่องวิทยานิพนธ์	การวิเคราะห์แบบจำลองการพยากรณ์ที่เหมาะสมและการวัดความ เป็นอิสระ: หุ่นอสังหาริมทรัพย์และดัชนีเงินในสาธารณรัฐ ประชาชนจีน	
ผู้วิจัย	นางสาว ลีลี่ ชู	
ปริญญา	เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต	
คณะกรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์	รศ. ดร. กาญจนา โชคถาวร	อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก
	อ.ดร. ชูเกียรติ ชัยบุญศรี	อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม
	รศ. ดร. ประเสริฐ ไชยทิพย์	อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

บทคัดย่อ

รายงานวิจัยฉบับนี้มีวัตถุประสงค์หลักสองประการ ประการที่หนึ่ง จะหาตัวแบบจำลองที่เหมาะสมสำหรับการพยากรณ์หุ้นภาคอสังหาริมทรัพย์กับดัชนีเงินในสาธารณรัฐประชาชนจีนตามลำดับ ในอีกประการหนึ่ง งานวิจัยนี้จะวิเคราะห์การวัดความเกี่ยวพันกันระหว่างดัชนีหุ้นทั้งสองประเภทในประเทศจีน. วิธีการลินีเยอร์และวิธีการนอนลินีเยอร์ ได้ถูกนำมาใช้เพื่อแสวงหาตัวแบบที่เหมาะสมสำหรับดัชนีหุ้นแต่ละประเภท และได้้นำวิธีการเอ็มพีริคอลคอปพูลามาใช้เพื่อทดสอบความน่าเชื่อถือที่เกี่ยวข้องกันระหว่างดัชนีทั้งสอง ผลที่ได้รับ: ประการแรก คือแบบอโตรีเกรสลิฟ-ลินีเยอร์ โมเดล (เออาร์-ลินีเยอร์ โมเดล) มีความเหมาะสมสำหรับพยากรณ์หุ้นภาคอสังหาริมทรัพย์กับดัชนีเงินในระหว่างปี. 2006 ถึงปี 2012 ประการที่สอง ด้วยการใช่วิธีการเอ็มพีริคอลคอปพูลาวัดความเกี่ยวพันกันระหว่างร้อยละของผลตอบแทนของหุ้นภาคอสังหาริมทรัพย์กับดัชนีเงินมีความเกี่ยวพันกันมาก.

Thesis Title	The Appropriate Forecasting Models and Dependence Measurement: Real Estate Sector Stock and Shenzhen Index in People's Republic of China	
Author	Ms. Lili Zhou	
Degree	Master of Economics	
Thesis Advisory Committee		
	Assoc. Prof. Dr. Kanchana Chokethaworn	Advisor
	Lect. Dr. Chukiatt Chaiboonsri	Co-advisor
	Assoc. Prof. Dr. Prasert Chaitip	Co-advisor

ABSTRACT

This paper mainly has two purposes. On the one hand, it aims to find the appropriate models for forecasting the Real Estate Sector Stock and Shenzhen Index in People's Republic of China, respectively. On the other hand, this paper will analyze the dependence measures between these two kinds of stock indexes in China. The linear method and nonlinear method was introduced for seeking the appropriate models for each stock index. And the empirical copula method was implied to examine the dependence measures between these two indexes. The results

are: Firstly, the Autoregressive-linear model (AR-linear Model) fits for forecasting the Real Estate Sector Stock and Shenzhen Index over the period of 2006 to 2012. Secondly, based on the empirical copula approach, the dependence measures between returns in percentage of Real Estate Sector Stock and Shenzhen Index is very strong.