

การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ของความผันผวนระหว่างอัตราผลตอบแทน
ดัชนีหุ้นกลุ่มพลังงาน และกลุ่มขนส่งในตลาดหลักทรัพย์
แห่งประเทศไทย

ประไพศรี ทิพย์แก้ว

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กรกฎาคม 2552

การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ของความผันผวนระหว่างอัตราผลตอบแทน
ดัชนีหุ้นกลุ่มพลังงาน และกลุ่มขนส่งในตลาดหลักทรัพย์
แห่งประเทศไทย

ประไพศรี ทิพย์แก้ว

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กรกฎาคม 2552

การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ของความผันผวนระหว่างอัตราผลตอบแทนดัชนี
หุ้นกลุ่มพลังงาน และกลุ่มขนส่งในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ประไพศรี ทิพย์แก้ว

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต


คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ


.....ประธานกรรมการ

อ.ดร.ประพัฒน์นม จริยะพันธุ์


.....กรรมการ

ผศ.ดร.อัญชลี เจ็งเจริญ


.....กรรมการ

ผศ.ดร.ไพรัช กาญจนการุณ


.....กรรมการ

ผศ.ดร.นิลิต พันชมิตร

15 กรกฎาคม 2552

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้สำเร็จลุล่วงไปได้ด้วยดี โดยได้รับความกรุณาของ ผศ.ดร.ไพรัช กาญจนการุญ ที่ได้สละเวลารับเป็นประธานที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ ซึ่งได้ให้คำแนะนำถึงประเด็นต่าง ๆ ในการศึกษา และชี้แนวทางในการแก้ปัญหา อันเป็นประโยชน์ในการวิเคราะห์ และสรุปผลการศึกษา นอกจากนี้ผู้เขียนขอขอบพระคุณ ผศ.ดร.นิสิต พันธมิตร ที่ได้กรุณาสละเวลาอันมีค่ารับเป็นคณะกรรมการการค้นคว้าแบบอิสระ โดยให้ข้อเสนอแนะที่มีประโยชน์ต่อการศึกษา รวมถึงการตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องต่าง ๆ ส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สมบูรณ์มากยิ่งขึ้น ผู้เขียนจึงขอขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณคณาจารย์คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ทุกท่าน ที่ได้กรุณาถ่ายทอดความรู้อันมีค่า และสามารถนำมาใช้ประโยชน์ในการทำการศึกษาวิจัยในครั้งนี้ และขอขอบคุณเจ้าหน้าที่ บรรณารักษ์ห้องสมุดคณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ที่ให้คำแนะนำช่วยเหลือบริการด้านต่าง ๆ เป็นอย่างดีตลอดระยะเวลาที่ศึกษา

สุดท้ายนี้ หากการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้จะเป็นประโยชน์แก่หน่วยงานที่เกี่ยวข้อง ตลอดจนผู้สนใจข้อมูล ผู้เขียนขอมอบความดีงามให้แก่ คุณพ่อประสิทธิ์ ทิพย์แก้ว และคุณแม่ยุพิน ทิพย์แก้ว ผู้ที่ให้การสนับสนุน ดูแล และเป็นกำลังใจที่สำคัญยิ่งในการศึกษามาจนทุกวันนี้ ในส่วนของความผิดพลาดหรือข้อบกพร่องต่างๆ ผู้เขียนขออภัยมา ณ โอกาสนี้และน้อมรับไว้แต่เพียงผู้เดียว และผู้เขียนหวังว่าการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้จะมีประโยชน์ต่อผู้ลงทุน และหน่วยงานที่เกี่ยวข้องได้ใช้ในการกำหนดนโยบาย และวางแผนการลงทุนต่อไป