

การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณหลักทรัพย์
ในกลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์
แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน

ชลัท จิวหานัง

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กันยายน 2548

การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณหลักทรัพย์
ในกลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์
แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน

ชลัท จิวหานัง

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่


กันยายน 2548

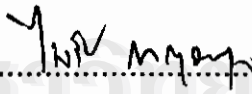
การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณหลักทรัพย์
ในกลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์
แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน

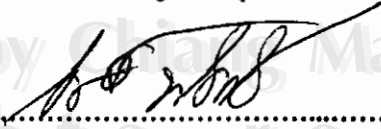
ชลัท จิวหานัง

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ


..... ประธานกรรมการ
รศ. ชเนต ศรีวิชัยลำพันธ์


..... กรรมการ
อ.ดร.ไพรัช กาญจนการุณ


..... กรรมการ
อ.ดร.นิสิต พันธมิตร

22 กันยายน 2548

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าวิจัยแบบอิสระนี้สำเร็จลงได้ด้วยความกรุณาจาก รองศาสตราจารย์ ชเนศ ศรีวิชัยลำพันธ์ อาจารย์ที่ปรึกษาการค้นคว้าวิจัยแบบอิสระ ผู้ซึ่งได้ให้ความรู้ คำแนะนำ คำปรึกษา ที่เป็นประโยชน์ และตรวจทานแก้ไขข้อบกพร่องจนการค้นคว้าวิจัยแบบอิสระนี้เสร็จสมบูรณ์ ผู้เขียนจึงขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณ อาจารย์ ดร. ไพรัช กาญจนการุณ และ อาจารย์ ดร. นิสิต พันธมิตร ที่กรุณารับเป็นกรรมการตรวจสอบการค้นคว้าวิจัยแบบอิสระ อีกทั้งยังให้คำแนะนำที่เป็นประโยชน์เป็นอย่างดี

ขอขอบคุณอาจารย์ ศุภรัตน์ ภาสน์พิพัฒน์กุล ที่กรุณาให้คำแนะนำเป็นอย่างดี ขอขอบคุณเจ้าหน้าที่ศูนย์การเงินและการลงทุน ที่ให้คำปรึกษาและคำแนะนำ ตลอดจนเจ้าหน้าที่ ห้องงานบริการการศึกษา และบรรณารักษ์ห้องสมุดคณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ ที่ช่วยอำนวยความสะดวกในด้านต่าง ๆ เป็นอย่างดี

ขอกราบขอบพระคุณ คุณพ่อ คุณแม่ และพี่ชาย ที่ได้ให้ความช่วยเหลือและเป็นกำลังใจ ในการทำการศึกษาค้นคว้าวิจัยแบบอิสระในครั้งนี้ และขอขอบคุณ เพื่อน ๆ ทุกคนที่ให้ คำปรึกษาและเป็นกำลังใจในการทำการศึกษาค้นคว้าวิจัยแบบอิสระในครั้งนี้

ท้ายสุดนี้ หากมีสิ่งใดที่บกพร่อง หรือมีข้อผิดพลาดประการใด ผู้เขียนขออภัยเป็นอย่าง สูง ในข้อบกพร่องและผิดพลาดนั้น และผู้เขียนหวังว่าการค้นคว้าวิจัยแบบอิสระนี้คงเป็น ประโยชน์ไม่มากนักน้อยสำหรับผู้สนใจที่จะศึกษา ตลอดจนผู้ที่สนใจที่จะลงทุนในหลักทรัพย์ กลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์ต่อไป