

การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหลักทรัพย์  
และมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์  
กลุ่มอาเซียน โดยวิธี พาแนล โคอินทิเกรชัน

ปริญญาภรณ์ ด้วงบุญมา

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
Copyright© by Chiang Mai University  
All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
มิถุนายน 2553

การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหลักทรัพย์  
และมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์  
กลุ่มอาเซียน โดยวิธี พาแนล โคอินทิเกรชัน

ปริญญาภรณ์ ดั่งวงบุญมา

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง  
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
Copyright© by Chiang Mai University  
All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
มิถุนายน 2553

การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหลักทรัพย์  
และมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์  
กลุ่มอาเซียน โดยวิธี พาแนล โคอินทิเกรชัน

ปรัชญาภรณ์ ตังบุญมา

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา  
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ



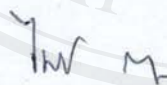
.....ประธานกรรมการ

รศ.อารีย์ เชื้อเมืองพาน



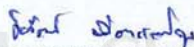
.....กรรมการ

รศ.ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์



.....กรรมการ

ผศ.ดร.ไพรัช กาญจนการุณ



.....กรรมการ

อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์กุล

23 มิถุนายน 2553

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

## กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ สำเร็จลุล่วงลงได้ด้วยความกรุณาของ รศ.ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ ประธานกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ ที่ได้เสียสละเวลาในการให้ความรู้ คำแนะนำและคำปรึกษาที่เป็นประโยชน์ต่อการศึกษา อีกทั้งยังให้ความช่วยเหลือและให้การสนับสนุนในทุกๆ ด้านอย่างดียิ่ง รวมถึงการตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องต่างๆ ซึ่งผู้เขียนขอขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้ และขอขอบพระคุณ รศ.อารีย์ เชื้อเมืองพาน ผศ.ดร.ไพรัช กาญจนการุณ และ อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์กุล กรรมการการค้นคว้าแบบอิสระที่ได้ให้ข้อเสนอแนะที่มีคุณค่าต่อการศึกษา พร้อมทั้งตรวจสอบข้อผิดพลาดต่างๆ อันส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สมบูรณ์มากยิ่งขึ้น

ขอขอบพระคุณคณาจารย์คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ ที่ได้ให้ความรู้ด้านเศรษฐศาสตร์ ขอขอบคุณข้าราชการ เจ้าหน้าที่ ตลอดจนบรรณารักษ์ห้องสมุดของคณะเศรษฐศาสตร์ และ ดร.ชูเกียรติ ชัยบุญศรี ที่ให้คำแนะนำช่วยเหลือ บริการประสานงานและอำนวยความสะดวกต่างๆ เป็นอย่างดีตลอดระยะเวลาที่ศึกษา ขอขอบคุณเพื่อนนักศึกษาปริญญาโทเศรษฐศาสตร์ ภาคพิเศษ รุ่นที่ 8 ที่เป็นกำลังใจ และสนับสนุนในการศึกษาค้นคว้าครั้งนี้จนสำเร็จได้สมบูรณ์

สุดท้ายนี้หากการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้จะเป็นประโยชน์แก่หน่วยงานที่เกี่ยวข้อง ตลอดจนผู้สนใจข้อมูล ผู้เขียนขอมอบความดีงามให้แก่คุณพ่อ คุณแม่ และญาติพี่น้อง ผู้ที่ให้การดูแลและเป็นกำลังใจที่สำคัญยิ่งในการศึกษามาจนทุกวันนี้ ในส่วนของความผิดพลาดหรือข้อบกพร่องประการใด ผู้เขียนขอนอบบรรเทาไว้เพียงผู้เดียว

ปริญญารัตน์ คังบุญมา