

การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณของหลักทรัพย์  
กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย  
โดยวิธีโคอินทิเกรชัน

วรลักษณ์ ชมภูพงษ์

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง  
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

บัณฑิตวิทยาลัย  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
พฤษภาคม 2548

การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณของหลักทรัพย์  
กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย  
โดยวิธีโคอินทิเกรชัน

วราลักษณ์ ชมภูพงษ์

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา  
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

 ประธานกรรมการ

อ.ดร.ไพรัช กาญจนการุณ

 กรรมการ

อ.ดร.นิสิต พันธมิตร

 กรรมการ

ผศ. สุรภา วิเศษสุวรรณ

10 พฤษภาคม 2548

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

## กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้สำเร็จลงได้ด้วยความกรุณาจาก อาจารย์ ดร.ไพรัช กาญจนการณ อาจารย์ที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ ผู้ซึ่งกรุณาให้ความรู้ คำแนะนำ คำปรึกษาและตรวจแก้ไขงานการค้นคว้าแบบอิสระเสร็จสมบูรณ์ ผู้เขียนจึงขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณ รศ. ธเนศ ศรีวิชัยลำพันธ์, ผศ. สุรภร วิศิษฐ์สุวรรณและอาจารย์ ดร. นิสิต พันธมิตร ที่กรุณาได้รับเป็นกรรมการตรวจสอบการค้นคว้าแบบอิสระและให้คำแนะนำเป็นอย่างดีตลอดมา

ขอขอบคุณบรรณารักษ์ห้องสมุดคณะเศรษฐศาสตร์และเจ้าหน้าที่ประจำคณะเศรษฐศาสตร์ทุกท่านที่ช่วยอำนวยความสะดวกในด้านต่าง ๆ ด้วยดี

ขอขอบคุณ คุณพ่อ คุณแม่ พี่สาว ที่เป็นกำลังใจและให้การสนับสนุนด้านการเรียนมาโดยตลอด และขอบคุณเพื่อนๆ ทุกคนที่เป็นกำลังใจและให้คำแนะนำในการศึกษาค้นคว้าแบบอิสระนี้

คุณความดีทั้งหมดที่อาจเกิดขึ้นขอมอบแด่ อาจารย์ คุณพ่อ คุณแม่ พี่สาวตลอดจนผู้มีพระคุณต่อผู้เขียนทุกท่านหากมีสิ่งใดขาดตกบกพร่องหรือผิดพลาดประการใด ผู้เขียนขออภัยเป็นอย่างสูงในข้อบกพร่องและความผิดพลาดนั้น และผู้เขียนหวังว่าการค้นคว้าแบบอิสระนี้คงมีประโยชน์บ้างไม่มากก็น้อยสำหรับหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง ตลอดจนผู้ที่สนใจต่อไป

วาราลักษณ์ ชมภูพงษ์