

การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณการซื้อขาย
หลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
โดยวิธีโคอินทิเกรชัน

สุชาสินี พลอยงุ่นศรี

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

เมษายน 2548

การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณการซื้อขาย
หลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
โดยวิธีโคอินทิเกรชัน

สุธาณี พลอยอุ่งศรี

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

.....
อ.ดร.ไพรัช กาญจนการุณ ประธานกรรมการ

.....
อ.ดร.นิสิต พันธมิตร กรรมการ

.....
รศ.ชเนศ ศรีวิชัยคำพันธ์ กรรมการ

28 เมษายน 2548

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้สำเร็จลงได้ด้วยความช่วยเหลือจาก อาจารย์ ดร.ไพรัช กาญจนการุณ อาจารย์ที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ ผู้ซึ่งกรุณาให้ความรู้ คำแนะนำ และตรวจแก้ไขจนการค้นคว้าแบบอิสระเสร็จสมบูรณ์ ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอขอบพระคุณอาจารย์ ดร.นิตติ พันธมิตร และรองศาสตราจารย์ ธเนศ ศรีวิชัยลำพันธ์ ที่กรุณาได้รับเป็นกรรมการตรวจสอบการค้นคว้าแบบอิสระ และให้คำแนะนำเป็นอย่างดีมาตลอด

ขอขอบคุณอาจารย์ที่ปรึกษาโครงการปริญญาโท เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต ภาคพิเศษ 1 ปีทุกท่านที่คอยช่วยเหลือให้ความรู้และคำแนะนำที่ดีเสมอมา ขอขอบคุณเจ้าหน้าที่ศูนย์การเงิน และการลงทุนที่สละเวลาให้คำปรึกษาต่างๆ เกี่ยวกับการประมวลผลข้อมูล และที่ขาดมิได้ผู้เขียนขอขอบคุณบรรณารักษ์ห้องสมุดคณะเศรษฐศาสตร์ และเจ้าหน้าที่คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ทุกท่านที่ช่วยอำนวยความสะดวกในด้านต่างๆ เป็นอย่างดีเสมอมา

นอกจากนี้ขอกราบขอบพระคุณญาติทุกท่าน โดยเฉพาะอย่างยิ่ง คุณพ่อ คุณแม่ พี่ชาย และน้องสาว ที่ได้ให้ความช่วยเหลือและเป็นกำลังใจในการทำ การค้นคว้าแบบอิสระครั้งนี้ และขอขอบคุณเพื่อนนักศึกษาปริญญาโททุกท่าน ที่ให้ความช่วยเหลือและเป็นกำลังใจที่ดี

ท้ายสุดนี้ หากมีสิ่งขาดตกบกพร่องหรือผิดพลาดประการใด ผู้เขียนขออภัยเป็นอย่างสูงในข้อบกพร่องและความผิดพลาดนั้น และผู้เขียนหวังว่าการค้นคว้าแบบอิสระนี้คงมีประโยชน์บ้างไม่มากก็น้อยสำหรับผู้ที่เกี่ยวข้องและผู้สนใจที่จะศึกษา

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

สุธาณี พลอยอรุณศรี