

การศึกษาโคอินทิเกรชันและการจำแนกองค์ประกอบของความแปรปรวน
ของดัชนีหลักทรัพย์แห่งชาติหลังวิกฤตทางการเงินในภูมิภาคเอเชีย

เรื่องรอง สุวรรณการ

วิทยานิพนธ์นี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กรกฎาคม 2546

การศึกษาโคอินทิเกรชันและการจำแนกองค์ประกอบของความแปรปรวน
ของดัชนีหลักทรัพย์แห่งชาติหลังวิกฤตทางการเงินในภูมิภาคเอเชีย

เรื่องรอง สุวรรณการ

วิทยานิพนธ์นี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบวิทยานิพนธ์



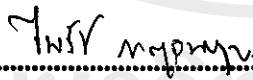
.....ประธานกรรมการ

อาจารย์ ดร. ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์



.....กรรมการ

รองศาสตราจารย์ ดร. อารี วิบูลย์พงศ์



.....กรรมการ

อาจารย์ ดร. ไพรัช กาญจนการุณ



.....กรรมการ

รองศาสตราจารย์ อารีย์ เรือเมืองพาน

4 กรกฎาคม 2546

© ลิขสิทธิ์ของบัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณอาจารย์ ดร. ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ ที่กรุณารับเป็นอาจารย์ที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์ และเสียสละเวลาอันมีค่าให้คำปรึกษา ความรู้ คำแนะนำ ข้อเสนอแนะ ข้อคิดเห็นที่เป็นประโยชน์ในการศึกษา ให้ความช่วยเหลือ ตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องต่าง ๆ รวมทั้งได้กรุณาติดตามความคืบหน้าของการทำวิทยานิพนธ์มา โดยตลอดจนกระทั่งวิทยานิพนธ์ฉบับนี้เสร็จ ลุล่วงไปด้วยดี

ขอกราบขอบพระคุณรองศาสตราจารย์ ดร. อารี วิบูลย์พงศ์ อาจารย์ ดร. ไพรัช กาญจนการุณ และรองศาสตราจารย์ อารีย์ เชื้อเมืองพาน ที่กรุณารับเป็นกรรมการที่ปรึกษา และได้กรุณาเสียเวลาอันมีค่าให้คำแนะนำ คำปรึกษา ที่เป็นประโยชน์แก่ผู้เขียน และช่วยตรวจสอบข้อบกพร่องต่าง ๆ จนทำให้วิทยานิพนธ์ฉบับนี้สมบูรณ์มากยิ่งขึ้น

นอกจากนี้ ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณ รองศาสตราจารย์ ดร. มณฑล สงวนเสริมศรี อธิการบดีมหาวิทยาลัยนครสวรรค์ ที่ให้โอกาสผู้เขียนศึกษาต่อในระดับปริญญาโทและให้การสนับสนุนทุนการศึกษาจากทางมหาวิทยาลัยนครสวรรค์แก่ผู้เขียนจนจบการศึกษา และขอขอบพระคุณ อาจารย์รุจิรัตน์ ชัยแสง อาจารย์ประจำภาควิชาภาษาอังกฤษ คณะมนุษยศาสตร์และสังคมศาสตร์ มหาวิทยาลัยนครสวรรค์ ที่ให้การสนับสนุน ให้ความช่วยเหลือในทุก ๆ ด้าน คำปรึกษา คำแนะนำและเป็นกำลังใจมาโดยตลอด ตลอดจน พี่ ๆ เพื่อน ๆ น้อง ๆ นักศึกษาปริญญาโท สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์ ที่ให้ความช่วยเหลือและเป็นกำลังใจจนทำให้วิทยานิพนธ์ฉบับนี้เสร็จสมบูรณ์ลงได้

สุดท้ายผู้เขียนขอขอบพระคุณ คุณพ่อไพศาล คุณแม่คำแปง และพี่สาว คุณศรีวิไลย์ สุวรรณการ ผู้ซึ่งเป็นทุกสิ่งทุกอย่าง ให้กำลังใจ คำปรึกษา และให้การสนับสนุนด้านการเรียนและกำลังใจทรัพย์สินที่ดีแก่ผู้เขียนเสมอมา ตลอดจนคณาจารย์ทุกท่านในทุกระดับที่อบรมสั่งสอน ประสิทธิ์ประสาทวิชาความรู้ให้แก่ผู้เขียน รวมถึงคณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่และเจ้าหน้าที่ใน ส่วนต่าง ๆ ของคณะเศรษฐศาสตร์ ที่เอื้อเฟื้อสถานที่และสิ่งอำนวยความสะดวกต่าง ๆ แก่ผู้เขียน คุณประโยชน์ทั้งหมดที่เกิดจากวิทยานิพนธ์ฉบับนี้ผู้เขียนขอมอบแด่คุณพ่อ คุณแม่ พี่สาว คณาจารย์ ตลอดจนผู้มีพระคุณต่อผู้เขียนทุกท่าน ส่วนข้อบกพร่องต่าง ๆ ผู้เขียนขอน้อมรับไว้แต่เพียงผู้เดียว