

การวิเคราะห์ความสัมพันธ์เชิงคุณภาพระยะยาวของราคาน้ำมันดิบกับ
ราคาหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในประเทศไทย
โดยวิธีเทรซโฮลด์โคอินทิเกรชัน

ภรณ์ศิริ ไชยลิขิต

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
All rights reserved
กุมภาพันธ์ 2555

การวิเคราะห์ความสัมพันธ์เชิงคุณภาพระยะยาวของราคาน้ำมันดิบกับ
ราคาหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในประเทศไทย
โดยวิธีเทรซโฮลด์โคอินทิเกรชัน

ภรณ์ศิริ ไชยลิขิต

วิทยานิพนธ์นี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
All rights reserved
กุมภาพันธ์ 2555

การวิเคราะห์ความสัมพันธ์เชิงคุณภาพระยะยาวของราคาน้ำมันดิบกับ
ราคาหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในประเทศไทย
โดยวิธีเทรซโฮลด์โคอินทิเกรชัน

ภรณ์ศิริ ไชยลิขิต

วิทยานิพนธ์นี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบวิทยานิพนธ์

คณะกรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์

.....ประธานกรรมการ

รศ.ชนรัักษ์ เมฆขยาย

.....กรรมการ

อ.ดร.ชูเกียรติ ชัยบุญศรี

.....กรรมการ

อ.ดร.อนุภาค เสาร์เสาวภาคย์

.....กรรมการ

รศ.ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์

.....อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก

อ.ดร.ชูเกียรติ ชัยบุญศรี

.....อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

อ.ดร.อนุภาค เสาร์เสาวภาคย์

.....อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

รศ.ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์

16 กุมภาพันธ์ 2555

ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

วิทยานิพนธ์ฉบับนี้สำเร็จลุล่วงได้ด้วย ความกรุณาและความช่วยเหลือจากคณาจารย์และผู้มีพระคุณทุกท่านเป็นอย่างดี โดยเฉพาะอย่างยิ่งจากอาจารย์ ดร.ชูเกียรติ ชัยบุญศรี ประธานที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์ ที่ได้เสียสละเวลาในการให้ความรู้ คำแนะนำ และคำปรึกษาอันเป็นประโยชน์ต่อการวิเคราะห์และสรุปผลการศึกษา ผู้เขียนขอขอบพระคุณอาจารย์ ดร.อนุภาค เสาร์เสาวภาคย์ ที่ได้ให้ข้อเสนอแนะที่มีคุณค่าต่อการศึกษา อีกทั้งยังให้ความช่วยเหลือสนับสนุนในทุก ๆ ด้านอย่างดียิ่ง รวมถึงการตรวจสอบแก้ไขข้อผิดพลาดต่าง ๆ ที่เกิดขึ้น อันส่งผลให้วิทยานิพนธ์ฉบับนี้ดีสมบูรณ์มากยิ่งขึ้น นอกจากนี้ผู้เขียนขอขอบพระคุณท่านรองศาสตราจารย์ ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์ ที่ได้ให้คำแนะนำดี ๆ อันส่งผลให้วิทยานิพนธ์ฉบับนี้สำเร็จ และเป็นผลงานที่มีคุณภาพ

ขอกราบขอบพระคุณคณาจารย์ประจำคณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ทุกท่าน ที่ได้ประสิทธิ์ประสาทวิชาความรู้ด้วยความเอาใจใส่และความเมตตาตลอดมา และขอขอบคุณเจ้าหน้าที่ประจำคณะเศรษฐศาสตร์ทุกท่านที่ให้ความดูแล ช่วยเหลือมาตลอดหลักสูตรการศึกษา

ขอขอบคุณแรงสนับสนุนและกำลังใจที่ได้รับจากเพื่อน ๆ นักศึกษาปริญญาโท สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์ หลักสูตรสองภาษา จนทำให้วิทยานิพนธ์ฉบับนี้เสร็จสมบูรณ์ลงได้

ท้ายสุดนี้หากการศึกษาเพื่อทำวิทยานิพนธ์ฉบับนี้จะเป็นประโยชน์ต่อผู้ที่สนใจ ผู้เขียนขอมอบความดีงามให้แก่ คุณพ่อสัมพันธ์ คุณแม่สมร ไชยลิขิต น้องสาว น้องชาย ที่ให้ความรัก และเป็นกำลังใจที่สำคัญยิ่งในการศึกษามาจนถึงทุกวันนี้

ในส่วนของความผิดพลาดหรือข้อบกพร่องต่าง ๆ ผู้เขียนขอน้อมรับไว้เพียงผู้เดียว

ภรณ์ศิริ ไชยลิขิต