

การศึกษาแนวโน้มราคาหุ้นกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย  
โดยใช้แบบจำลอง ARIMA

บุษรินทร์ ติวะนันท์

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง  
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา  
บริหารธุรกิจมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กันยายน 2548

การศึกษาแนวโน้มราคาหุ้นกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย  
โดยใช้แบบจำลอง ARIMA


บุษรินทร์ ติวะนันท์

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา  
ตามหลักสูตรปริญญาบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต

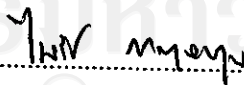
คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ



.....ประธานกรรมการ  
อาจารย์ ดร. รวี ลงานี



.....กรรมการ  
อาจารย์ สุจรรย์พันธ์ สุวรรณพันธ์



.....กรรมการ  
อาจารย์ ดร. ไพรัช กาญจนการณ

1 กันยายน 2548

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

## กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ สำเร็จได้ด้วยความอนุเคราะห์และความกรุณาเป็นอย่างสูง จาก อาจารย์ ดร. รวี ลงกานี อาจารย์สุจรชัยพันธ์ สุวรรณพันธ์ และอาจารย์ ดร. ไพรัช กาญจนการุณ ที่กรุณาเป็นกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ รวมทั้งให้คำปรึกษาและชี้แนะแนวทางต่างๆ แก่ผู้ศึกษา ตลอดจนแก้ไขปรับปรุงข้อบกพร่อง อันเป็นประโยชน์ต่อการศึกษาเป็นอย่างมาก จึงขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงมา ณ ที่นี้

ขอขอบพระคุณ คณาจารย์และคณะผู้บริหารในหลักสูตรบริหารธุรกิจ สำหรับผู้บริหาร จังหวัดสมุทรสาคร มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ทุกท่าน ที่ได้กรุณาประสิทธิ์ประสาทวิชา และให้ความรู้ความเข้าใจในวิชาการต่างๆ เป็นอย่างมาก พร้อมกันนี้ ขอขอบพระคุณ ศูนย์ข้อมูลการเงินการลงทุน คณะบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ และเจ้าหน้าที่ประจำศูนย์ข้อมูลการเงินการลงทุน ที่กรุณาเอื้อเฟื้อข้อมูลเพื่อใช้ในการค้นคว้าแบบอิสระในครั้งนี้ ขอขอบคุณ เพื่อนนักศึกษาระดับปริญญาโท มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ หลักสูตรบริหารธุรกิจ สำหรับผู้บริหาร จังหวัดสมุทรสาครทุกท่าน ที่ให้ความร่วมมือและเป็นกำลังใจในการศึกษา

สุดท้ายนี้ ผู้ศึกษาขอขอบพระคุณบิดามารดา และน้องๆ ผู้ที่อะเป็นกำลังใจและกรุณาให้การสนับสนุนการศึกษา ด้วยความจริงใจเสมอมา

บุญรินทร์

ติวะนั้นนทกร