

การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์อัตราแลกเปลี่ยนเงินตรา  
ต่างประเทศระหว่างแบบจำลองนิรอลเน็ตเวิร์ค แบบจำลองอาร์มา  
แบบจำลองการชเอ็ม



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
Copyright© by Chiang Mai University  
All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
กรกฎาคม 2550

การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์อัตราแลกเปลี่ยนเงินตรา  
ต่างประเทศระหว่างแบบจำลองนิเวศเน็ตเวิร์ค แบบจำลองอาร์มา  
แบบจำลองการชเอ็ม

อดิเรก จันทร์สัด

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง  
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University  
All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กรกฎาคม 2550

การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์อัตราแลกเปลี่ยนเงินตรา  
ต่างประเทศระหว่างแบบจำลองนิวโรลเน็ตเวิร์ค แบบจำลองอาร์มีมา  
แบบจำลองการชเอ็ม

อติเรก จันทร์สัด

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา  
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

ประธานกรรมการ

ผศ.คมสัน สุริยะ

กรรมการ

รศ.พรทิพย์ เขียวธีรวิทย์

กรรมการ

อ.กนต์สินี กันทะวงศ์วาร

20 กรกฎาคม 2550

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

## กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ สำเร็จลงได้ด้วยดี โดยได้รับความกรุณาเป็นอย่างยิ่งจาก ผศ.คมสัน สุริยะ ที่ได้ให้ความกรุณาสละเวลารับเป็นประธานที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ ซึ่งได้ให้คำแนะนำถึงประเด็นต่างๆ ในการศึกษาและชี้แนวทางในการแก้ปัญหา อันเป็นประโยชน์ในการวิเคราะห์และสรุปผลการศึกษา รวมทั้งการแก้ไขงานให้สมบูรณ์ยิ่งขึ้น นอกจากนี้ ผู้เขียนขอขอบพระคุณ รศ.พรทิพย์ เขียวศรีวิทย์และอาจารย์กัณฑ์สินี กันทะวงค์วาร ที่ได้กรุณาสละเวลาอันมีค่ารับเป็นกรรมการค้นคว้าแบบอิสระ โดยได้ให้ข้อเสนอแนะที่มีคุณค่าต่อการศึกษา พร้อมทั้งตรวจสอบแก้ไขข้อผิดพลาดต่าง ๆ อันส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สำเร็จได้ด้วยดี และเป็นผลงานที่มีคุณภาพ เป็นความภาคภูมิใจของผู้จัดทำเป็นอย่างยิ่ง

ขอขอบพระคุณ คุณศุภยรัตน์ ภาสกรพิพัฒนกุล ที่ได้กรุณาสละเวลาอันมีค่าในการให้ความรู้ คำแนะนำ คำปรึกษา ตลอดจนชี้แนะแนวทางในการค้นคว้า และตรวจแก้ไขปรับปรุงด้วยความเมตตาเสมอมา ขอขอบพระคุณอาจารย์ทุกท่านเป็นอย่างสูงที่ได้ประสิทธิ์ประสาทความรู้อันเป็นรากฐานที่สำคัญในการประกอบสัมมาอาชีพ โดยเฉพาะอย่างยิ่งความรู้ทางด้านเศรษฐศาสตร์ที่ข้าพเจ้าจักได้นำไปสร้างคุณประโยชน์แก่ประเทศชาติต่อไปในภายภาคหน้า

ขอขอบคุณ เจ้าหน้าที่ประจำคณะเศรษฐศาสตร์ทุกท่านที่ให้ความดูแล ช่วยเหลือมาตลอดหลักสูตรการศึกษา ขอขอบคุณห้องสมุดต่างๆ ซึ่งเป็นแหล่งข้อมูลที่สำคัญในการเรียนและการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ ขอขอบคุณผู้ให้ข้อมูลทุกท่านที่มีอาจากกล่าวนามได้หมด ณ ที่นี้ ขอขอบคุณแรงสนับสนุนและกำลังใจที่ได้รับจากครอบครัวตลอดจนเพื่อนๆ จนทำให้การค้นคว้าอิสระฉบับนี้เสร็จสมบูรณ์ลงได้

ท้ายที่สุดนี้ หากมีข้อผิดพลาดประการใด ผู้เขียนขอน้อมรับไว้แต่ผู้เดียว และผู้เขียนหวังว่าการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้จะมีประโยชน์ต่อผู้ลงทุนและหน่วยงานที่เกี่ยวข้องได้ใช้ในการกำหนดนโยบายและวางแผนการลงทุนต่อไป