

การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับดัชนีหมวดธุรกิจ
ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย



อุษสยา แพทย์เจริญ

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

พฤษภาคม 2552

การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับดัชนีหมวดธุรกิจ
ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

อุษสยา แพทย์เจริญ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

พฤษภาคม 2552

การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับดัชนีหมวดธุรกิจ
ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

อุษยา แพทย์เจริญ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

ไพรัช

ประธานกรรมการ

ผศ.ดร.ไพรัช กาญจนการุณ

อ.อุษยา

กรรมการ

ผศ.ดร.อัญชลี เจ็งเจริญ

อ.ประพัฒน์

กรรมการ

อ.ดร.ประพัฒน์ จริยะพันธุ์

น.นิต

กรรมการ

ผศ.ดร.นิต พันธ์มิตร

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

13 พฤษภาคม 2552

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ สำเร็จลงได้ด้วยความกรุณาของ อาจารย์ ดร.ประพัฒน์ จริยะพันธุ์ ประธานที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระที่ได้เสียสละเวลาในการให้ความรู้ คำแนะนำ และคำปรึกษาที่มีประโยชน์ต่อการศึกษา อีกทั้งให้ความช่วยเหลือและให้การสนับสนุนในด้านต่างๆ รวมถึงการตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องต่างๆ ซึ่งผู้เขียนขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.ไพรัช กาญจนการุณ ประธานกรรมการ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร. อัญชลี เจริญ และ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.นิสิต พันธมิตร กรรมการการค้นคว้าแบบอิสระ ที่ได้ให้ข้อเสนอแนะที่มีคุณค่าต่อการศึกษา พร้อมทั้งตรวจสอบแก้ไขข้อผิดพลาดต่างๆ ที่เกิดขึ้น ตลอดจนให้คำแนะนำต่าง ๆ อันส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ สมบูรณ์มากยิ่งขึ้น

ขอบพระคุณคณาจารย์คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ คณาจารย์รับเชิญทุกท่าน ที่ได้ให้ความรู้ด้านเศรษฐศาสตร์ และขอขอบคุณเจ้าหน้าที่ ตลอดจนบรรณารักษ์ห้องสมุดของคณะเศรษฐศาสตร์ที่ได้ให้คำแนะนำช่วยเหลือ บริการ ประสานงานด้านต่างๆ เป็นอย่างดีตลอดระยะเวลาที่ศึกษา

ขอขอบคุณคุณพิกุล แซ่โล้ว ตลอดจนเจ้าหน้าที่บริษัทหลักทรัพย์กิมเองที่ให้ความอนุเคราะห์ด้านข้อมูลและเป็นกำลังใจ รวมทั้งเพื่อนๆ นักศึกษาปริญญาโทเศรษฐศาสตร์ (ภาคพิเศษ) รุ่นที่ 14 ที่ได้ให้ความช่วยเหลือและเป็นกำลังใจด้วยดีตลอดระยะเวลาการศึกษา

ขอขอบคุณคุณอัครพงศ์ อันทอง ที่กรุณาให้คำแนะนำและชี้แนวทางในการค้นคว้า
สุดท้ายนี้ หากการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้จะ เป็นประโยชน์แก่หน่วยงานที่เกี่ยวข้อง ตลอดจนผู้ที่สนใจ ผู้เขียนขอแสดงความดีใจให้แก่บิดา มารดา ซึ่งเป็นกำลังใจที่สำคัญยิ่งในการศึกษามาจนทุกวันนี้ รวมถึงคุณ ไตรทศ กลิ่นอุทัย ผู้ให้คำแนะนำและกำลังใจจนการศึกษาในครั้งนี้สำเร็จสมบูรณ์ ในส่วนของความผิดพลาดหรือข้อบกพร่องต่างๆ ผู้เขียนขอน้อมรับไว้เพียงผู้เดียว และขออภัยมา ณ ที่นี้ด้วย

อุษษา แพทย์เจริญ