

ผลกระทบของอัตราแลกเปลี่ยนที่มีต่อดัชนีตลาดหลักทรัพย์ของประเทศ
ในเอเชียโดยวิธีเวกเตอร์ออร์โตรีเกรสชัน



เลิศลาภ เผลยเกียรติฉายา

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กันยายน 2553

ผลกระทบของอัตราแลกเปลี่ยนที่มีต่อดัชนีตลาดหลักทรัพย์ของประเทศ
ในเอเชียโดยวิธีเวกเตอร์ออร์โตรีเกรเซชัน

เลิศลาภ เกลยเกียรติฉายา

วิทยานิพนธ์นี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กันยายน 2553

ผลกระทบบของอัตราแลกเปลี่ยนที่มีต่อดัชนีตลาดหลักทรัพย์ของประเทศ
ในเอเชียโดยวิธีเวกเตอร์ออโตรีเกรซซีฟ

เลิศลาภ เกลยเกียรติฉายา

วิทยานิพนธ์นี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบวิทยานิพนธ์


.....ประธานกรรมการ
ผศ.ดร.ไพรัช กาญจนการุณ



.....กรรมการ
ผศ.ดร.อัญชลี เจ็งเจริญ


.....กรรมการ
ผศ.ดร.นิสิต พันธมิตร


.....กรรมการ
อ.ดร.ประพัฒน์ จริยะพันธุ์

คณะกรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์


.....อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก
ผศ.ดร.นิสิต พันธมิตร


.....อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม
อ.ดร.ประพัฒน์ จริยะพันธุ์

30 กันยายน 2553

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

วิทยานิพนธ์นี้สำเร็จได้ด้วยความกรุณาจาก ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.นิสิต พันชมิตร อาจารย์ที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์ ผู้ซึ่งกรุณาให้ความรู้ คำแนะนำ คำปรึกษา ตรวจสอบและแก้ไขจนวิทยานิพนธ์ฉบับนี้เสร็จสมบูรณ์ ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้ ขอกราบขอบพระคุณ อาจารย์ ดร. ประพัฒน์ จริยะพันธุ์ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.ไพรัช กาญจนการุณ และผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.อัญชติ เจริญเจริญ ที่กรุณารับเป็นคณะกรรมการสอบวิทยานิพนธ์ พร้อมทั้งให้ข้อเสนอแนะที่มีคุณค่าต่อการศึกษา และตรวจสอบแก้ไขข้อผิดพลาดต่างๆเกิดขึ้นจนวิทยานิพนธ์ฉบับนี้เสร็จสมบูรณ์มากยิ่งขึ้น

ขอขอบพระคุณคณาจารย์คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ทุกท่านที่ได้ให้ความรู้ทางด้านเศรษฐศาสตร์ เจ้าหน้าที่ ตลอดจนบรรณารักษ์ของสมุดคณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ที่ให้คำแนะนำช่วยเหลือ ประสานงานด้านต่างๆ เป็นอย่างดีตลอดระยะเวลาที่ทำการศึกษา

ขอขอบคุณเจ้าหน้าที่ศูนย์การเงินและการลงทุน (FIC) มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ ที่ได้ให้ความอนุเคราะห์ข้อมูลและคำแนะนำที่มีประโยชน์ต่อการศึกษาครั้งนี้

ที่สำคัญที่สุดข้าพเจ้าขอกราบขอบพระคุณบิดา มารดา และญาติพี่น้องทุกท่านที่ได้อบรมสั่งสอน เป็นกำลังใจ และสนับสนุนข้าพเจ้าในทุกๆ ด้านเสมอมา จนข้าพเจ้ามีทุกวันนี้

ท้ายที่สุด ขอขอบพระคุณทุกท่าน ทั้งที่กล่าวถึงและไม่ได้กล่าวถึง ที่ได้มีส่วนช่วยเหลือในการทำวิทยานิพนธ์ฉบับนี้จนสำเร็จลุล่วงไปได้ด้วยดี ข้าพเจ้าหวังเป็นอย่างยิ่งว่าวิทยานิพนธ์ฉบับนี้จะเป็นประโยชน์ต่อผู้ที่สนใจไม่มากนักน้อย และหากมีข้อผิดพลาดหรือข้อบกพร่องประการใด ข้าพเจ้าต้องขออภัยเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้