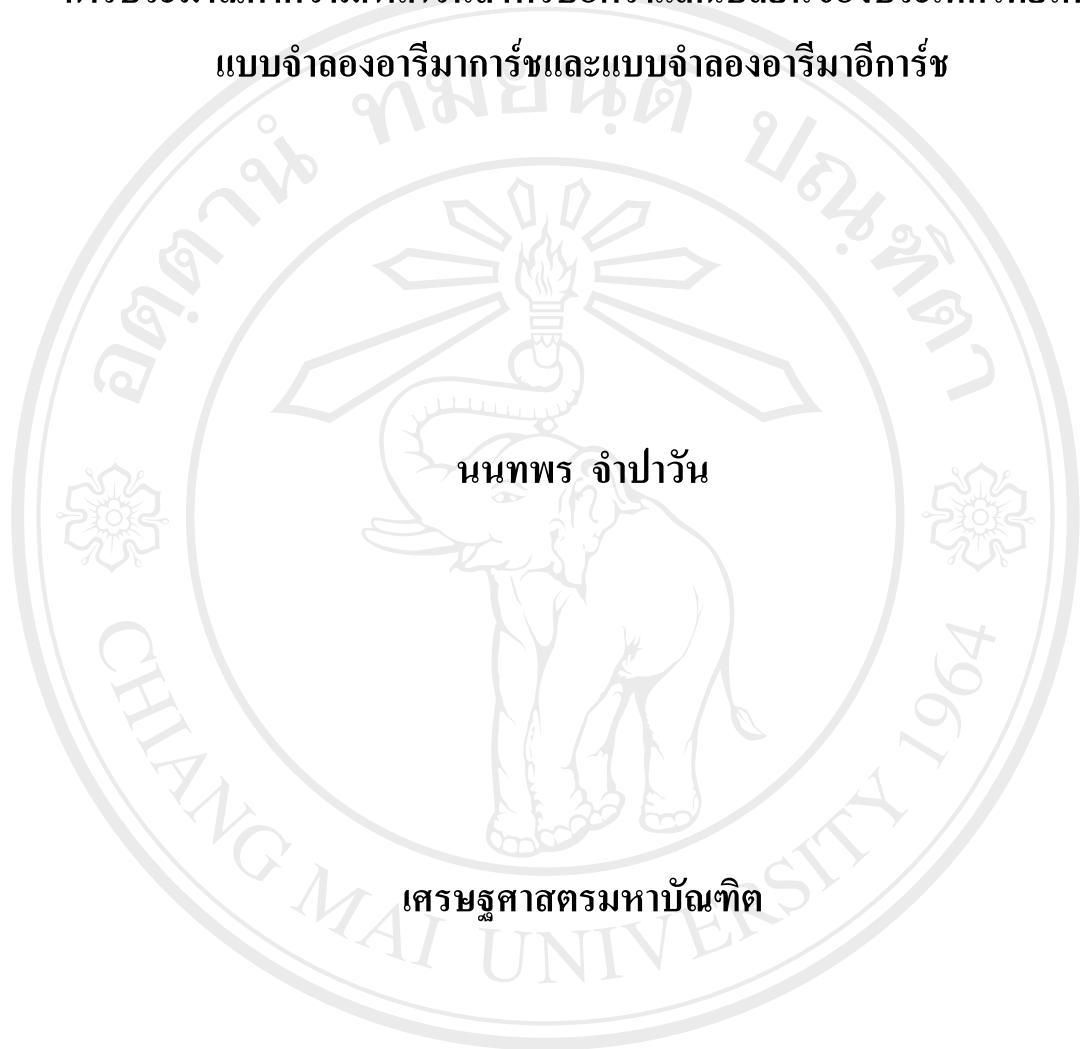


การประมาณค่าความผันผวนสำหรับอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศไทยโดย
แบบจำลองอาร์มาร์ชและแบบจำลองอาร์มาร์ช



นนทพร จำปวัน

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

ตุลาคม 2550

การประมาณค่าความผันผวนสำหรับอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศไทย
โดยแบบจำลองอาร์มาร์ชและแบบจำลองอาร์มาร์ช

นนทพร จำปาวิน

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

ตุลาคม 2550

การประมาณค่าความผันผวนสำหรับอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศไทยโดย
แบบจำลองอาร์มีมาร์ชและแบบจำลองอาร์มีไอการ์ช

นนทพร จำปาวาน

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

.....ประธานกรรมการ

รศ.ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์

.....กรรมการ

รศ.กาญจนา โชคถาวร

.....กรรมการ

อ.ดร.เยาวเรศ เขาวนพูนผล

8 ตุลาคม 2550

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สำเร็จลงได้ด้วยดี โดยได้รับความกรุณาเป็นอย่างยิ่งจากท่านรองศาสตราจารย์ ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ ที่ได้ให้ความกรุณาสละเวลารับเป็นประธานที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ ซึ่งได้ให้คำแนะนำถึงประเด็นต่างๆ ในการศึกษาและชี้แนวทางในการแก้ปัญหา อันเป็นประโยชน์ในการวิเคราะห์และสรุปผลการศึกษา รวมทั้งการแก้ไขงานให้สมบูรณ์ยิ่งขึ้น นอกจากนี้ผู้เขียนขอขอบพระคุณ รศ.กาญจนา โชคถาวร และอาจารย์ ดร.เยาวเรศ เซาวนพูนผล ที่ได้กรุณาสละเวลาอันมีค่ารับเป็นกรรมการค้นคว้าแบบอิสระ โดยได้ให้ข้อเสนอแนะที่มีคุณค่าต่อการศึกษา พร้อมทั้งตรวจสอบแก้ไขข้อผิดพลาดต่าง ๆ อันส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สำเร็จได้ด้วยดี และเป็นผลงานที่มีคุณภาพ เป็นความภาคภูมิใจของผู้จัดทำเป็นอย่างยิ่ง

ขอขอบพระคุณอาจารย์ชัยวัฒน์ นิรมอนุสสรณ์กุล ที่ได้กรุณาสละเวลาอันมีค่าในการให้ความรู้ คำแนะนำ คำปรึกษา ตลอดจนชี้แนะแนวทางในการค้นคว้า และตรวจแก้ไขปรับปรุงด้วยความเมตตาเสมอมา ขอขอบพระคุณอาจารย์ทุกท่านเป็นอย่างสูงที่ได้ประสิทธิ์ประสาทความรู้อันเป็นรากฐานที่สำคัญในการประกอบสัมมาอาชีพ โดยเฉพาะอย่างยิ่งความรู้ทางด้านเศรษฐศาสตร์ที่ข้าพเจ้าจักได้นำไปสร้างคุณประโยชน์แก่ประเทศชาติต่อไปในภายภาคหน้า

ขอขอบคุณ เจ้าหน้าที่ประจำคณะเศรษฐศาสตร์ ทุกท่านที่ให้ความดูแล ช่วยเหลือมาตลอดหลักสูตรการศึกษา ขอขอบคุณห้องสมุดต่างๆ ซึ่งเป็นแหล่งข้อมูลที่สำคัญในการเรียนและการค้นคว้าอิสระฉบับนี้ ขอขอบคุณผู้ให้ข้อมูลทุกท่านที่มีจากกล่าวนามได้หมด ณ ที่นี้ ขอขอบคุณแรงสนับสนุนและกำลังใจที่ได้รับจากครอบครัวตลอดจนเพื่อนๆ จนทำให้การค้นคว้าอิสระฉบับนี้เสร็จสมบูรณ์ลงได้

ท้ายที่สุดนี้ หากมีข้อผิดพลาดประการใด ผู้เขียนขอน้อมรับไว้แต่ผู้เดียว และผู้เขียนหวังว่าการค้นคว้าอิสระฉบับนี้จะมีประโยชน์ต่อผู้ลงทุนและหน่วยงานที่เกี่ยวข้องได้ใช้ในการกำหนดนโยบายและวางแผนการลงทุนต่อไป