

แบบจำลองการส่งผ่านความผันผวนและความสัมพันธ์แบบมีเงื่อนไข
ระหว่างตลาดหุ้นและตลาดพันธบัตรของ
ประเทศไทยและประเทศสิงคโปร์

นิติวัชณ์ ดวงงาม

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กันยายน 2552

แบบจำลองการส่งผ่านความผันผวนและความสัมพันธ์แบบมีเงื่อนไข
ระหว่างตลาดหุ้นและตลาดพันธบัตรของ
ประเทศไทยและประเทศสิงคโปร์

นิติวัชณ์ ดวงงาม

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กันยายน 2552

แบบจำลองการส่งผ่านความผันผวนและความสัมพันธ์แบบมีเงื่อนไข

ระหว่างตลาดหุ้นและตลาดพันธบัตรของ
ประเทศไทยและประเทศสิงคโปร์

นิติวรรณ ดวงงาม

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

.....ประธานกรรมการ

อ.ดร.ประพัฒน์ จริยะพันธ์

.....กรรมการ

ผศ.ดร.อัญชลี เจริญ

.....กรรมการ

รศ.ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

.....กรรมการ

Copyright © by รศ.ดร.ชเนศ ศรีวิชัยลำพันธุ์

All rights reserved

8 กันยายน 2552

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้สำเร็จลงได้ด้วยความกรุณาของ รองศาสตราจารย์ ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ อาจารย์ที่ปรึกษา ผู้ที่ได้ทุ่มเทเสียสละเวลาในการให้ความรู้ คำแนะนำ และคำปรึกษาที่มีประโยชน์ต่อการศึกษา อีกทั้งให้ความช่วยเหลือและให้การสนับสนุนในทุกๆด้านอย่างดียิ่งรวมถึง การตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องต่างๆ ซึ่งผู้เขียนขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้ ขอขอบพระคุณ อาจารย์ ดร.ประพัฒน์ จริยะพันธ์ ประธานกรรมการสอบ รองศาสตราจารย์ ดร. ธเนศ ศรีวิชัยลำพันธ์ และผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.อัญชลี เจิงเจริญ กรรมการ การค้นคว้าแบบอิสระ ที่ได้ให้ข้อเสนอแนะที่มีคุณค่าต่อการศึกษา พร้อมทั้งตรวจสอบแก้ไขข้อผิดพลาดต่างๆที่เกิดขึ้น ส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สมบูรณ์มากยิ่งขึ้น

ขอขอบพระคุณคณาจารย์คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ คณาจารย์รับเชิญทุกท่าน ที่ได้ให้ความรู้ด้านเศรษฐศาสตร์ ขอบคุณข้าราชการ เจ้าหน้าที่ตลอดจนบรรณารักษ์ห้องสมุดของ คณะเศรษฐศาสตร์ ที่ได้คำแนะนำช่วยเหลือบริการประสานงานด้านต่างๆ เป็นอย่างดีโดยตลอด ระยะเวลาที่ศึกษา

ขอกราบขอบพระคุณ บิดา มารดา ที่ได้ให้ความอนุเคราะห์ด้านการศึกษาให้ความช่วยเหลือ รวมทั้งให้ความเชื่อมั่นในตัวผู้เขียนและเป็นกำลังใจให้แก่ผู้เขียนเป็นอย่างดีมาตั้งแต่เริ่มต้นจนถึง ปัจจุบัน

ขอบคุณผู้ที่มีส่วนเกี่ยวข้องทุกๆ ท่านและเพื่อนๆ ทุกคนที่เป็นกำลังใจในการศึกษาการค้นคว้าแบบอิสระนี้

สุดท้ายนี้ผู้เขียนหวังว่าการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้จะเป็นประโยชน์ไม่มากนักน้อยแก่ผู้ที่สนใจศึกษาหรือหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง และหากมีสิ่งใดขาดตกบกพร่องหรือผิดพลาดประการใด ผู้เขียนขออภัยเป็นอย่างสูงและขอน้อมรับแต่เพียงผู้เดียว