

วิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ  
กับดัชนีตลาดหลักทรัพย์ในกลุ่มประเทศอาเซียน  
โดยวิธีแพนเนลโคอินทิเกรชัน

สุทธิพงษ์ สุวรรณศรี

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

พฤษภาคม 2554

วิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ  
กับดัชนีตลาดหลักทรัพย์ในกลุ่มประเทศอาเซียน  
โดยวิธีแพนเนลโคอินทิเกรชัน

สุทธิพงษ์ สุวรรณศรี

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง  
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

พฤษภาคม 2554

วิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ  
กับดัชนีตลาดหลักทรัพย์ในกลุ่มประเทศอาเซียน  
โดยวิธีแพนเนลโคอินทิเกรชัน

สุทธิพงษ์ สุวรรณศรี


การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา  
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

  
.....ประธานกรรมการ  
รศ.อารีย์ เชื้อเมืองพาน

  
.....กรรมการ  
รศ.ดร.ทองศักดิ์ ศรีบุญจิตต์


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

  
.....กรรมการ  
อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิมอนุสรณ์กุล

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ

  
.....อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก  
รศ.ดร.ทองศักดิ์ ศรีบุญจิตต์

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

  
.....อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม  
อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิมอนุสรณ์กุล

ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

20 พฤษภาคม 2554

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

## กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สำเร็จลุล่วงได้ด้วยความรู้ และคำแนะนำที่ได้รับจากคณาจารย์ คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ รวมถึงการได้รับความสนับสนุน และ กำลังใจจากบุคคลต่างๆ ซึ่งผู้เขียนจะขอกล่าว ณ ที่นี้ เพื่อเป็นการรำลึกถึงด้วยความขอบคุณ

ขอกราบขอบพระคุณ รศ.ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก รวมทั้ง อาจารย์ ดร.ประพัฒน์ชนม์ จริยะพันธุ์ และอาจารย์ ดร.ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์กุล อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม รวมถึง รศ.อารีย์ เชื้อเมืองพาน ที่คอยให้ความช่วยเหลือในการค้นคว้าแบบอิสระนี้ ได้ให้ข้อเสนอแนะที่มี คุณค่าต่อการศึกษา พร้อมทั้งตรวจสอบแก้ไขข้อผิดพลาดที่เกิดขึ้น ตลอดจนให้คำแนะนำต่างๆ อันส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สมบูรณ์มากยิ่งขึ้น

ขอกราบขอบพระคุณคณาจารย์คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ คณาจารย์รับเชิญทุกท่านที่ได้ให้ความรู้ตลอดจนแง่คิดในด้านต่างๆ เจ้าหน้าที่คณะเศรษฐศาสตร์ ตลอดจน บรรณารักษ์ห้องสมุด คณะเศรษฐศาสตร์ทุกท่านที่ได้ให้คำแนะนำช่วยเหลือบริการประสานงาน ด้านต่างๆ เป็นอย่างดีตลอดระยะเวลาที่ศึกษา

ขอกราบขอบพระคุณ บิดา มารดา ครอบครัว ที่ให้โอกาสและเป็นกำลังใจให้ด้วยดี ตลอดมาจนทำให้การศึกษาครั้งนี้สำเร็จลุล่วงได้อย่างสมบูรณ์ และขอขอบคุณเพื่อนๆ นักศึกษา ปริญญาโทเศรษฐศาสตร์ (ภาคพิเศษ) รุ่นที่ 16 ทุกท่าน ที่ได้ให้ความอนุเคราะห์ข้อมูลสนับสนุน ในการศึกษาค้นคว้าครั้งนี้ รวมทั้งให้ความช่วยเหลือ และเป็นกำลังใจดีตลอดระยะเวลาการศึกษานาน ทำให้การศึกษาค้นคว้าครั้งนี้สำเร็จได้อย่างสมบูรณ์

สุดท้ายนี้ หากการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้ จะเป็นประโยชน์แก่หน่วยงานที่เกี่ยวข้อง ตลอดจนผู้ที่สนใจข้อมูล ผู้เขียนขอขอบความดีงามให้แก่ผู้มีส่วนเกี่ยวข้องทุกท่าน และในส่วน ของความผิดพลาดหรือความบกพร่องต่างๆ ในรายงานการค้นคว้าอิสระนี้ ผู้เขียนขอน้อมรับไว้ เพียงผู้เดียว และ ขออภัยมา ณ ที่นี้ด้วย