

การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับอัตราผลตอบแทน
ของดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีไบวารรีเอทการซ์



ชมนานูช จันทรา

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กันยายน 2552

การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับอัตราผลตอบแทน
ของดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีไบวารรีเอทการซ์



การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
กันยายน 2552

การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับอัตราผลตอบแทน
ของดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีไบวารรีเอทการซ์

ชานนุช จันทรา

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

ไพฑูริ

ประธานกรรมการ

ผศ.ดร.ไพรัช กาญจนการุณ

อ.ดร.สังคม สุวรรณรัตน์

กรรมการ

อ.ดร.สังคม สุวรรณรัตน์

อ.ดร.ประพัฒน์ จริยะพันธุ์

กรรมการ

อ.ดร.ประพัฒน์ จริยะพันธุ์

ผศ.ดร.นิสิต พันธมิตร

กรรมการ

ผศ.ดร.นิสิต พันธมิตร

8 กันยายน 2552

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้สำเร็จลงได้ด้วยความช่วยเหลือของ อ.ดร.ประพัฒน์ชนม์ จริยะพันธุ์ ประธานที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ ที่ได้เสียสละเวลาในการให้ความรู้ คำแนะนำ และคำปรึกษา ที่มีประโยชน์ต่อการศึกษา อีกทั้งให้ความร่วมมือและให้การสนับสนุนในทุกๆ ด้านอย่างดียิ่ง รวมถึงการตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องต่างๆ ซึ่งผู้เขียนขอขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้ ขอขอบพระคุณ ผศ.ดร.นิสิต พันธมิตร อ.ดร.สังคม สุวรรณรัตน์ กรรมการการค้นคว้าแบบอิสระและ ผศ.ดร.ไพรัช กาญจนการุณ ประธานกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ ได้ให้ข้อเสนอแนะที่มีคุณค่าต่อการศึกษา พร้อมทั้งตรวจสอบแก้ไขข้อผิดพลาดต่างๆ ที่เกิดขึ้น ส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สมบูรณ์มากยิ่งขึ้น

ขอขอบพระคุณคณาจารย์คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ คณาจารย์รับเชิญทุกท่าน ที่ได้ให้ความรู้ด้านเศรษฐศาสตร์ ขอขอบคุณข้าราชการ เจ้าหน้าที่ตลอดจนบรรณารักษ์ห้องสมุดของคณะเศรษฐศาสตร์ ที่ได้คำแนะนำช่วยเหลือบริการประสานงานด้านต่างๆ เป็นอย่างดีโดยตลอดระยะเวลาที่ศึกษา

ขอขอบพระคุณผู้ที่มีส่วนเกี่ยวข้องทุกๆ ท่านและเพื่อนๆ ทุกคนที่เป็นกำลังใจในการค้นคว้าแบบอิสระนี้

ขอกราบขอบพระคุณ บิดา มารดา ที่ได้ให้ความอนุเคราะห์ด้านการศึกษา ให้ความช่วยเหลือ และเป็นกำลังใจให้แก่ผู้เขียนเป็นอย่างดีมาตั้งแต่เริ่มต้นจนถึงปัจจุบัน

สุดท้ายนี้ผู้เขียนหวังว่าการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้จะเป็นประโยชน์ไม่มากนักน้อยแก่ผู้ที่สนใจศึกษาหรือหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง และหากมีสิ่งใดขาดตกบกพร่องหรือผิดพลาดประการใด ผู้เขียนขออภัยเป็นอย่างสูงและขอน้อมรับไว้แต่เพียงผู้เดียว

ลิขสิทธิ์ในผลงานนี้สงวนลิขสิทธิ์โดยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved