

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	จ
สารบัญตาราง	
สารบัญภาพ	
สารบัญตารางภาคผนวก	
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 หลักการและเหตุผล	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	5
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ	5
1.4 ขอบเขตการศึกษา	5
1.5 นิยามศัพท์	5
บทที่ 2 ทฤษฎี และผลงานการศึกษาที่เกี่ยวข้อง	
2.1 ทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง	6
2.1.1 ทฤษฎีเกี่ยวกับความเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจ	6
2.1.2 ทฤษฎีบทอนุกรมเวลา	15
2.1.3 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล unit root	16
2.1.4 การทดสอบความสอดคล้องของข้อมูลอนุกรมเวลา (Cointegration test)	19
2.1.5 การทดสอบ Error Correction Mechanism (ECM)	20
2.1.6 การทดสอบต้นเหตุ (Granger Causality)	21
2.2 เอกสาร และงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	23

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright © by Chiang Mai University
 All rights reserved

บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย

3.1	แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา	27
3.2	ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	28
3.3	วิธีการศึกษา	28
3.3.1	การทดสอบของข้อมูล	28
3.3.2	การทดสอบความนิ่ง (unit root test)	28
3.3.3	การทดสอบความสัมพันธ์ของข้อมูลอนุกรมเวลา (Cointegration)	29
3.3.4	การทดสอบ Error Correction Mechanism (ECM)	30
3.3.5	การทดสอบสมมติฐานเชิงเหตุเป็นผล (Causality Test)	32

บทที่ 4 ผลการศึกษา และการวิเคราะห์ข้อมูล

4.1	ผลการทดสอบความนิ่ง (unit root test)	36
4.1.1	ผลการทดสอบ Unit Root ของตัวแปรรายได้จากการท่องเที่ยว (tourism)	36
4.1.2	ผลการทดสอบ unit root ของตัวแปรผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ (Real GDP)	38
4.2	การทดสอบการร่วมไปด้วยกันของข้อมูลอนุกรมเวลา (cointegration test)	39
4.3	การทดสอบ error correlation mechanism (ECM)	41
4.4	การทดสอบสมมติฐานเชิงเหตุเป็นผล (causality test)	44

บทที่ 5 สรุปผลการศึกษา

5.1	การทดสอบความนิ่งของข้อมูล	47
5.1.1	ผลการทดสอบ Unit Root ของตัวแปรรายได้จากการท่องเที่ยว (tourism)	47
5.1.2	ผลการทดสอบ unit root ของตัวแปรผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ (real GDP)	47
5.2	การทดสอบการร่วมไปด้วยกันของข้อมูลอนุกรมเวลา (cointegration test)	48
5.3	การทดสอบ error correlation mechanism (ECM)	48
5.4	การทดสอบสมมติฐานเชิงเหตุเป็นผล (causality test)	49

เอกสารอ้างอิง

ภาคผนวก		
ภาคผนวก ก ข้อมูลที่นำมาศึกษา		53
ภาคผนวก ข ผลการวิเคราะห์ข้อมูล		55
ประวัติผู้เขียน		66



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright© by Chiang Mai University
 All rights reserved

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
1.1 แสดงจำนวนนักท่องเที่ยวระหว่างประเทศที่เดินทางเข้าประเทศไทยและวันหยุดปี 2548-2549	2
4.1 แสดงผลการทดสอบ unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey Fuller ของข้อมูลรายได้จากการท่องเที่ยวของประเทศไทย ณ ระดับ I(0)	36
4.2 แสดงผลการทดสอบ unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey Fuller ของข้อมูลรายได้จากการท่องเที่ยวของประเทศไทย ณ ระดับ I(1)	37
4.3 แสดงผลการทดสอบ unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey Fuller ของข้อมูลผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ ณ ระดับ I(0)	38
4.4 แสดงผลการทดสอบ unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey Fuller ของข้อมูลผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ ณ ระดับ I(1)	39
4.5 แสดงผลการทดสอบ unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey Fuller ของค่าความคลาดเคลื่อน ณ ระดับ I(0)	40
4.6 แสดงผลการทดสอบ unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey Fuller ของค่าความคลาดเคลื่อน ณ ระดับ I(0)	40
4.7 แสดงผลการทดสอบ cointegration และ unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey Fuller ของค่าความคลาดเคลื่อน ณ ระดับ I(0)	41
4.8 แสดงผลการทดสอบ error correction mechanism(ECM)	42
4.9 แสดงผลการทดสอบ autocorrelation ด้วยวิธี Breusch-Godfrey serial correlation LM test	43
4.10 แสดงผลการทดสอบ autocorrelation ด้วยวิธี Breusch-Godfrey serial correlation LM test	44
4.11 แสดงการเลือกช่วงเวลาที่เหมาะสมสำหรับการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล	45
4.12 แสดงผลการทดสอบ Granger causality	46

สารบัญภาพ

รูป	หน้า
1.1 แสดงจำนวนรายได้จากนักท่องเที่ยวที่เดินทางเข้าท่องเที่ยวประเทศไทย ปี 2540-2549	2
1.2 การเปรียบเทียบความสามารถในการแข่งขันของอุตสาหกรรมท่องเที่ยว	4
4.1 แสดงรายได้จากการท่องเที่ยวของประเทศไทย ในแต่ละไตรมาสตั้งแต่ พ.ศ. 2541- 2550	35
4.2 แสดงผลิตภัณฑ์ภายในประเทศ หรือ Real GDP ในแต่ละไตรมาสตั้งแต่ พ.ศ. 2541- 2550	35



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright© by Chiang Mai University
 All rights reserved

สารบัญตารางภาคผนวก

ตาราง	หน้า
1ก แสดงข้อมูลรายได้จากการท่องเที่ยวของประเทศไทย และผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศไทย	54
1ข การทดสอบ unit root ของตัวแปร log ของรายได้จากการท่องเที่ยว ที่ระดับ $I(1)$ lag 2 กรณีที่ไม่มีทั้งค่าคงที่ และแนวโน้มเวลา ช่วงที่เหมาะสมที่สุด	56
2ข การทดสอบ serial correlation LM test ของการทดสอบ unit root ของตัวแปร log ของรายได้จากการท่องเที่ยว ที่ระดับ $I(1)$ lag 2 กรณีที่ไม่มีทั้งค่าคงที่ และแนวโน้มเวลา	57
3ข การทดสอบ unit root ของตัวแปร log ของผลิตภัณฑ์มวลรวมของประเทศไทย ที่ระดับ $I(1)$ lag 0 กรณีที่ไม่มีทั้งค่าคงที่ และแนวโน้มเวลา ช่วงที่เหมาะสมที่สุด	57
4ข การทดสอบ serial correlation LM test ของการทดสอบ unit root ของตัวแปร log ของผลิตภัณฑ์มวลรวมของประเทศไทยที่ระดับ $I(1)$ lag 0 กรณีที่ไม่มีทั้งค่าคงที่ และแนวโน้มเวลา	58
5ข การทดสอบ cointegration กรณีที่รายได้จากการท่องเที่ยวเป็นตัวแปรอิสระ และผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศเป็นตัวแปรตาม	58
6ข การทดสอบ cointegration กรณีที่รายได้จากการท่องเที่ยวเป็นตัวแปรตาม และผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศเป็นตัวแปรอิสระ	59
7ข การทดสอบ unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey Fuller ของค่าความคลาดเคลื่อน ณระดับ $I(0)$ กรณีที่ รายได้จากการท่องเที่ยวเป็นตัวแปรอิสระ และผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศเป็นตัวแปรตาม	60
8ข การทดสอบ unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey Fuller ของค่าความคลาดเคลื่อน ณระดับ $I(0)$ กรณีที่รายได้จากการท่องเที่ยวเป็นตัวแปรตาม และผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศเป็นตัวแปรอิสระ	61
9ข การทดสอบ Error Correction Mechanism กรณีที่รายได้จากการท่องเที่ยวเป็นตัวแปรอิสระ และผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศเป็นตัวแปรตาม	62

10ข	การทดสอบ serial correlation LM test ของการทดสอบ Error Correction Mechanism กรณีที่รายได้จากการท่องเที่ยวเป็นตัวแปรอิสระ และผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศเป็นตัวแปรตาม	62
11ข	การทดสอบ Error Correction Mechanism กรณีที่รายได้จากการท่องเที่ยวเป็นตัวแปรตาม และผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศเป็นตัวแปรอิสระ	63
12ข	การทดสอบ serial correlation LM test ของการทดสอบ Error Correction Mechanism กรณีที่รายได้จากการท่องเที่ยวเป็นตัวแปรตาม และผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ เป็นตัวแปรอิสระ	63
13ข	การเลือกช่วงเวลาที่เหมาะสม AIC และ SC ช่วงเวลาที่ 1 (lag 1)	64
14ข	การเลือกช่วงเวลาที่เหมาะสม AIC และ SC ช่วงเวลาที่ 2 (lag 2)	64
15ข	การเลือกช่วงเวลาที่เหมาะสม AIC และ SC ช่วงเวลาที่ 3 (lag 3)	64
16ข	การเลือกช่วงเวลาที่เหมาะสม AIC และ SC ช่วงเวลาที่ 4 (lag 4)	64
17ข	การเลือกช่วงเวลาที่เหมาะสม AIC และ SC ช่วงเวลาที่ 5 (lag 5)	65
18ข	การทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล (Granger Causality test)	65