

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ก
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ญ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	4
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา	4
1.4 แหล่งที่มาของข้อมูลและขอบเขตการศึกษา	4
บทที่ 2 ทฤษฎี แนวคิด และวรรณกรรมปริทัศน์	
2.1 ทฤษฎีบทอนุกรมเวลา	5
2.2 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล unit root	6
2.3 การทดสอบความสอดคล้องของข้อมูลอนุกรมเวลา (Cointegration test)	8
2.4 การทดสอบ Error Correction Mechanism (ECM)	10
2.5 การทดสอบต้นเหตุ (Granger Causality)	11
2.6 แนวคิดแบบจำลองการกำหนดอัตราแลกเปลี่ยน	12
2.7 นิยามของอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริง	17
บทที่ 3 ระเบียบวิธีการวิจัย	
3.1 การทดสอบความนิ่ง (Unit Root Test)	18
3.2 การทดสอบความสอดคล้องของข้อมูลอนุกรมเวลา (Cointegration)	19

3.3 การทดสอบ Error Correlation Mechanism (ECM)	20
3.4 การทดสอบสมมติฐานเชิงเหตุเป็นผล (Causality Test)	22
บทที่ 4 ผลการศึกษา	
4.1 ผลการทดสอบ Unit Root	25
4.2 การทดสอบความสัมพันธ์ของข้อมูลอนุกรมเวลา (Cointegration test)	28
4.3 ผลการทดสอบ Error Correction Mechanism (ECM)	31
4.4 ผลการทดสอบ Granger Causality	35
บทที่ 5 สรุปผลและข้อเสนอแนะ	
5.1 สรุปผลการศึกษา	37
5.2 ข้อเสนอแนะ	38
เอกสารอ้างอิง	40
ภาคผนวก	
ภาคผนวก ก ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	42
ภาคผนวก ข ผลการวิเคราะห์ข้อมูล	48
ภาคผนวก ค วิธีคำนวณอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริง (REER)	75
ประวัติผู้เขียน	76

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
1.1 แสดงจำนวนรายได้จากนักท่องเที่ยวที่เข้ามาท่องเที่ยวในประเทศไทย ปี พ.ศ. 2540 – 2549	2
1.2 แสดงจำนวนนักท่องเที่ยวที่เข้ามาท่องเที่ยวในประเทศไทย ปี พ.ศ. 2540 – 2549	3
4.1 ผลการทดสอบ Unit root ของข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริง ณ ระดับ I(0) ระดับนัยสำคัญที่ 0.01	22
4.2 ผลการทดสอบ unit root ของข้อมูลรายได้ที่แท้จริงในการท่องเที่ยวของประเทศไทยจากนักท่องเที่ยวต่างชาติ ณ ระดับ I(0)	23
4.3 ผลการทดสอบ Cointegration และ Unit Root ของค่าความคลาดเคลื่อนที่กำหนดให้ REER เป็นตัวแปรต้น และ TOUR เป็นตัวแปรตาม	25
4.4 ผลการทดสอบ Cointegration และ Unit Root ของค่าความคลาดเคลื่อนที่กำหนดให้ TOUR เป็นตัวแปรต้น และ REER เป็นตัวแปรตาม	26
4.5 ผลการทดสอบ Error Correction Mechanism (ECM) เมื่อ D(REER) เป็น Dependent Variable	28
4.6 ผลการทดสอบ Error Correction Mechanism (ECM) เมื่อ D(TOUR) เป็น Dependent Variable	30
4.7 เลือกช่วงเวลาที่เหมาะสมสำหรับการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล	32
4.8 ผลการทดสอบ Granger Causality	33