

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ก
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง ญ	
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	8
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา	8
1.4 ขอบเขตการศึกษาและวิธีการวิจัย	8
บทที่ 2 กรอบแนวคิดทางทฤษฎีและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	
2.1 กรอบแนวคิด	9
2.2 ทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง	9
2.2.1 การวิเคราะห์อนุกรมเวลา (Time Series Analysis)	9
2.2.2 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root Test)	9
2.2.3 แบบจำลอง Auto Regressive (AR(p))	11
2.2.4 แบบจำลอง Moving Average (MA(q))	11
2.2.5 แบบจำลอง Auto Regressive Moving Average (ARMA(p,q))	12
2.2.6 แบบจำลอง Autoregressive conditional Heteroscedasticity (ARCH)	12
2.2.7 แบบจำลอง Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (GARCH)	14

2.2.8 แบบจำลอง Multivariate GARCH	15
2.2.9 แบบจำลองในการศึกษาความผันผวนของหลายตัวแปรพร้อมกัน	20
2.2.10 แบบจำลอง Vector Autoregressive Moving Average – GARCH (VARMA-GARCH)	21
2.3 งานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	21
บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย	24
บทที่ 4 ผลการศึกษา	
4.1 ผลการทดสอบยูนิตรูท (Unit Root Test)	27
4.2 ผลการทดสอบ Univariate GARCH ของระดับอัตราเงินเฟ้อ อัตราแลกเปลี่ยนและจำนวนนักท่องเที่ยวต่างชาติที่เข้ามาเที่ยวในประเทศไทย	32
4.3 ผลการทดสอบมัลติวาเรียเททการ์ช (Multivariate GARCH)	45
บทที่ 5 สรุปผลและข้อเสนอแนะ	53
เอกสารอ้างอิง	55
ภาคผนวก	
ภาคผนวก ก ผลการทดสอบ UNIT ROOT ของตัวแปรทั้งหมดที่ทำการศึกษ ด้วยวิธีการ Augmented Dickey-Fuller test	59
ภาคผนวก ข ผลการประมาณค่าพารามิเตอร์โดยวิธีมัลติวาเรียเททการ์ช	73
ประวัติผู้เขียน	83

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
4.1 ผลการทดสอบยูนิทรูท (Unit Root Test) ของระดับอัตราเงินเฟ้อของแต่ละประเทศ ณ ระดับ Level or I(0)	28
4.2 ผลการทดสอบยูนิทรูท (Unit Root Test) ของระดับอัตราเงินเฟ้อของแต่ละประเทศ ณ ระดับ First difference or I(1)	30
4.3 ผลการทดสอบยูนิทรูท (Unit Root Test) ของระดับอัตราเงินเฟ้อของแต่ละประเทศ ณ ระดับ Second difference or I(2)	31
4.4 ผลการทดสอบยูนิทรูท (Unit Root Test) ของระดับอัตราแลกเปลี่ยนของแต่ละประเทศ เมื่อเทียบกับเงินบาท ณ ระดับ Level or I(0)	31
4.5 ผลการทดสอบยูนิทรูท (Unit Root Test) ของระดับอัตราแลกเปลี่ยนของแต่ละประเทศ เมื่อเทียบกับเงินบาท ณ ระดับ First difference or I(1)	33
4.6 ผลการทดสอบยูนิทรูท (Unit Root Test) ของจำนวนนักท่องเที่ยวที่เข้ามาเที่ยวในประเทศไทย ของแต่ละประเทศ ณ ระดับ Level or I(0)	34
4.7 ผลการทดสอบยูนิทรูท (Unit Root Test) ของจำนวนนักท่องเที่ยวที่เข้ามาเที่ยวในประเทศไทย ของแต่ละประเทศ ณ ระดับ First difference or I(1)	35
4.8 ผลการทดสอบ Univariate GARCH ของระดับอัตราเงินเฟ้อของแต่ละประเทศ: สมการค่าเฉลี่ย	36
4.9 ผลการทดสอบ Univariate GARCH ของระดับอัตราเงินเฟ้อของแต่ละประเทศ: สมการความผันผวน	38
4.10 ผลการทดสอบ Univariate GARCH ของ GARCH ของอัตราแลกเปลี่ยนของแต่ละประเทศเมื่อเทียบกับเงินบาท: สมการค่าเฉลี่ย	41
4.11 ผลการทดสอบ Univariate GARCH ของ GARCH ของอัตราแลกเปลี่ยนของแต่ละประเทศเมื่อเทียบกับเงินบาท: สมการความผันผวน	42
4.12 ผลการทดสอบ Univariate GARCH ของจำนวนนักท่องเที่ยวที่เข้ามาเที่ยวในประเทศไทย : สมการค่าเฉลี่ย	45

4.13 ผลการทดสอบ Univariate GARCH ของจำนวนนักท่องเที่ยว
ที่เข้ามาเที่ยวในประเทศไทย : สมการความผันผวน



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved