

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ฉ
สารบัญภาพ	ฉ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 หลักการและเหตุผล	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	11
1.3 ประโยชน์ที่ได้รับจากการศึกษา	11
1.4 ขอบเขตของการศึกษา	11
1.5 นิยามศัพท์	12
บทที่ 2 ทฤษฎีและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	
2.1 ทฤษฎีความเสมอภาคของอำนาจซื้อ	13
(The Purchasing Power Parity Theory: PPP Theory)	
2.1.1 ทฤษฎีความเสมอภาคของอำนาจซื้ออย่างสมบูรณ์	14
2.1.2 ทฤษฎีความเสมอภาคของอำนาจซื้อโดยเปรียบเทียบ	14
2.2 วิธีการทางเศรษฐมิติ	16
2.2.1 การวิเคราะห์อนุกรมเวลา (Time Series Analysis)	17
2.2.2 การทดสอบยูนิทรูท (Unit Root)	17
2.2.3 แบบจำลอง Autoregressive Moving Average (ARMA(p,q))	19
2.2.4 เกณฑ์การเลือกรูปแบบของแบบจำลองที่ดีที่สุด (Model selection)	19
2.2.5 แบบจำลอง Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (ARCH)	20
2.2.6 แบบจำลอง Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity(GARCH)	22

2.2.7 แบบจำลอง Multivariate GARCH model	23
2.3 เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	25
บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย	
3.1 ทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root Test) ที่นำมาทำการศึกษา โดยวิธี Augmented Dickey – Fuller Test (ADF)	30
3.2 วิเคราะห์หาแบบจำลองที่เหมาะสม โดยการใช้แบบจำลอง Autoregressive Moving Average (ARMA(p,q)) และแบบจำลอง GARCH	31
3.3 เลือกแบบจำลองที่เหมาะสม (Model selection) โดยวิธี Schwarz Information Criteria (SIC)	33
3.4 การศึกษาความสัมพันธ์โดยวิธี Bivariate GARCH	33
บทที่ 4 ผลการศึกษา	
4.1 ผลการทดสอบยูนิทรูท (Unit Root Test)	35
4.2 ผลการประมาณค่า Mean Equation ของลือกการitimของอัตราแลกเปลี่ยน	38
4.3 ผลการทดสอบ Univariate GARCH ของลือกการitimของอัตราแลกเปลี่ยน	38
4.4 ผลการประมาณค่า Mean Equation ของลือกการitimของปริมาณ การนำเข้าน้ำมันดิบของประเทศไทย	39
4.5 ผลการทดสอบ Univariate GARCH ของลือกการitimของปริมาณ การนำเข้าน้ำมันดิบของประเทศไทย	40
4.6 ผลการทดสอบไบวารรีเอทการ์ซ (Bivariate GARCH)	40
บทที่ 5 สรุปผลการศึกษา และข้อเสนอแนะ	
5.1 สรุปผลการศึกษา	44
5.2 ข้อเสนอแนะ	45
เอกสารอ้างอิง	47
ภาคผนวก	

ภาคผนวก ก ผลการทดสอบยูนิทรูท (Uniy Root Test) โดยการทดสอบ Augmented Dickey-Fuller	50
ภาคผนวก ข การประมาณค่าพารามิเตอร์ (GARCH)	56
ภาคผนวก ค ผลการทดสอบ ARCH Effects	58
ภาคผนวก จ การประมาณค่าพารามิเตอร์ (Bivariate-GARCH)	60



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
1.1 วิวัฒนาการของระบบการเงินระหว่างประเทศของไทย	5
1.2 การนำเข้าน้ำมันตั้งแต่ พ.ศ. 2547-2551	8
1.3 แสดงการนำเข้าน้ำมันดิบรายประเทศตั้งแต่ พ.ศ. 2549-2551	8
1.4 สิ้นค่านำเข้าสำคัญ 15 รายการแรกของไทย พ.ศ. 2549 – 2552 (ม.ค. - ก.ค.)	10
4.1 ผลการทดสอบยูนิทรูท (Unit Root Test) ของลือกการิทึมของอัตราแลกเปลี่ยน	36
4.2 ผลการทดสอบยูนิทรูท (Unit Root Test) ของลือกการิทึมของปริมาณการนำเข้าน้ำมันดิบของประเทศไทย	37
4.3 ผลการประมาณค่า Mean Equation: สมการค่าเฉลี่ยของ Ine	38
4.4 ผลการทดสอบ Univariate GARCH: สมการความแปรปรวนของ Ine	38
4.5 ผลการทดสอบ ARCH Effect ของลือกการิทึมของอัตราแลกเปลี่ยน	39
4.6 ผลการประมาณค่า Mean Equation: สมการค่าเฉลี่ยของ Inm	39
4.7 ผลการทดสอบ Univariate GARCH: สมการความแปรปรวนของ Inm	40
4.8 ผลการทดสอบ ARCH Effect ของลือกการิทึมของปริมาณการนำเข้าน้ำมันดิบของประเทศไทย	40
4.9 ผลการทดสอบ ไบวารรีเอทการัวร์ช (Bivariate GARCH) ของลือกการิทึมของอัตราแลกเปลี่ยนและปริมาณการนำเข้าน้ำมันดิบของประเทศไทย	41

สารบัญภาพ

รูป	หน้า
1.1 อัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อดอลลาร์สหรัฐ ตั้งแต่ พ.ศ. 2534-2551	6
1.2 ปริมาณการนำเข้าน้ำมันดิบของประเทศไทยตั้งแต่ พ.ศ. 2534-2551	9
1.3 มูลค่าการนำเข้าน้ำมันดิบของประเทศไทยตั้งแต่ พ.ศ. 2534-2551	9
2.1 แสดงทฤษฎีความเสมอภาคของอำนาจซื้อ	15



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright© by Chiang Mai University
 All rights reserved