

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ญ
สารบัญภาพ	ฎ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 หลักการ ที่มา และความสำคัญ	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	5
1.3 ขอบเขตของการศึกษา	5
1.4 ประโยชน์ที่ได้รับจากการศึกษา	6
บทที่ 2 ทฤษฎี และงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	
2.1 ทฤษฎีทางเศรษฐศาสตร์	
2.1.1 เงินเฟ้อ	7
2.1.2 การว่างงาน	12
2.1.3 ความสัมพันธ์ระหว่างเงินเฟ้อกับการว่างงาน	18
2.1.4 ผลผลิต การว่างงาน และเงินเฟ้อ	22
2.2 วิธีการทางเศรษฐมิติ	
2.2.1 แนวคิดของข้อมูลอนุกรมเวลา (Time Series Data)	25
2.2.2 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Stationary) และการทดสอบ	
ยูนิตรูท (Unit Root Test)	25
2.2.3 แบบจำลอง Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (ARCH)	27
2.2.4 แบบจำลอง Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity	
(GARCH)	28

2.2.5 แบบจำลอง Multivariate GARCH model	29
2.2.6 การตรวจสอบรูปแบบ (Diagnostic Checking)	
2.2.6.1 การทดสอบ Ljung-Box Q-Statistic	31
2.2.6.2 เกณฑ์การเลือกรูปแบบของแบบจำลองที่ดีที่สุด (Model selection)	31
2.3 เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	32
บทที่ 3 เงินเฟ้อและการว่างงาน	36
บทที่ 4 ระเบียบวิธีวิจัย	
4.1 แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา	44
4.2 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	45
4.3 วิธีการศึกษาวิเคราะห์	46
บทที่ 5 ผลการศึกษา	
5.1 ผลการทดสอบ Unit Root	49
5.2 การประมาณค่าจากแบบจำลอง Autoregressive Moving Average (ARMA(p,q))	51
5.3 ผลการทดสอบ Univariate GARCH	51
5.4 ผลการทดสอบไบวารี่เรียเทกการซ์ (Bivariate GARCH)	55
บทที่ 6 สรุปผลการศึกษา และข้อเสนอแนะ	
6.1 สรุปผลการศึกษา	58
6.2 ข้อเสนอแนะ	59
เอกสารอ้างอิง	
ภาคผนวก	
ภาคผนวก ก ผลการทดสอบยูนิทรูท (Unit Root Test) โดยการทดสอบ Augmented Dickey-Fuller	63
ภาคผนวก ข คอเรลโลแกรม	69
ภาคผนวก ค การประมาณค่าพารามิเตอร์ (GARCH)	73

ลิขสิทธิ์ © by Chiang Mai University
All rights reserved

ภาคผนวก ง ผลการทดสอบ ARCH-effects	75
ภาคผนวก จ การประมาณค่าพารามิเตอร์ (Bivariate GARCH)	77
ประวัติผู้เขียน	78



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
5.1 ผลการทดสอบยูนิตรูท (Unit Root Test) ของอัตราเงินเฟ้อของประเทศไทย ณ ระดับ Level or I(0)	49
5.2 ผลการทดสอบยูนิตรูท (Unit Root Test) ของอัตราการว่างงานของประเทศไทย ณ ระดับ Level or I(0)	50
5.3 ผลการทดสอบ Lag p และ q ที่เหมาะสมสำหรับ แบบจำลองAutoregressive Moving Average (ARMA(p,q)) ของอัตราเงินเฟ้อและอัตราการว่างงานของประเทศไทย	51
5.4 ผลการทดสอบ Univariate GARCH ของอัตราเงินเฟ้อของประเทศไทย: สมการค่าเฉลี่ย	51
5.5 ผลการทดสอบ Univariate GARCH ของอัตราเงินเฟ้อของประเทศไทย: สมการความแปรปรวน	52
5.6 ผลการทดสอบ ACRH effects ของอัตราเงินเฟ้อของประเทศไทย	52
5.7 ผลการทดสอบ Univariate GARCH ของอัตราการว่างงานของประเทศไทย: สมการค่าเฉลี่ย	53
5.8 ผลการทดสอบ Univariate GARCH ของอัตราการว่างงานของประเทศไทย: สมการความแปรปรวน	53
5.9 ผลการทดสอบ ACRH effects ของอัตราการว่างงานของประเทศไทย	54
5.10 ผลการทดสอบไบเวจการ์ช (Bivariate GARCH) แสดงในรูปของแบบจำลอง DCC	55
5.11 แสดงความสัมพันธ์ของ Standardized Shock ระหว่างอัตราการว่างงานและอัตราเงินเฟ้อของประเทศไทย โดยแบบจำลอง Dynamic Conditional Correlation (DCC) และ Constant Conditional Correlation (CCC)	56

สารบัญภาพ

รูป	หน้า
1.1 อัตราเงินเฟ้อทั่วไปและอัตราเงินเฟ้อพื้นฐานรายเดือนที่ปรับฤดูกาล	2
1.2 อัตราการขยายตัวของการอุปโภคบริโภคของภาคเอกชน และการลงทุนภาคเอกชน	3
1.3 ภาวะการมีงานทำของประชากรในช่วงปี 2549 – มีนาคม 2552	4
2.1 แสดงเงินเฟ้อที่เกิดจากการเพิ่มปริมาณเงิน (Monetary sector)	8
2.2 แสดงเงินเฟ้อที่เกิดจากแรงดึงของอุปสงค์มวลรวม	9
2.3 แสดงเงินเฟ้อที่เกิดจากแรงดันของต้นทุน	11
2.4 แสดงระดับการจ้างงานคุณภาพในตลาดแรงงานของคลาสสิก	13
2.5 แสดงระดับการจ้างงานคุณภาพในตลาดแรงงานของเคนส์	14
2.6 แสดงการหดตัวของระบบเศรษฐกิจเมื่ออุปสงค์มวลรวมลดลง	16
2.7 แสดงการว่างงานในตลาดแรงงาน	17
2.8 แสดงเงินเฟ้อทางด้านต้นทุนต้น	18
2.9 แสดงเส้นโค้งฟิลลิปส์	20
2.10 แสดงเส้นโค้งฟิลลิปส์ที่มีคาดคะเนราคา	21
3.1 อัตราเงินเฟ้อและอัตราการว่างงานของประเทศไทย	41