

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ก
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ญ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์	5
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา	5
1.4 ขอบเขตการศึกษา	5
1.5 นิยามศัพท์	6
บทที่ 2 แนวคิด ทฤษฎีและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	
2.1 แนวคิด และทฤษฎี	7
2.2 เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	17
บทที่ 3 ระเบียบวิธีการศึกษา	
3.1 แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา	22
3.2 สมมติฐาน	23
3.3 วิธีการศึกษา	23
3.3.1 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล โดยการหา Unit Root	24
3.3.2 การสร้างแบบจำลอง VAR Model	25
3.3.3 การวิเคราะห์ Granger Causality Test	27
3.3.4 การวิเคราะห์ Impulse Response Function	28
3.3.5 การวิเคราะห์ Variance Decomposition	30
บทที่ 4 ผลการศึกษา	
4.1 ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Stationary)	33
4.2 การสร้างแบบจำลอง Vector Autoregression Model (VAR Model)	37
4.3 ผลการวิเคราะห์และกำหนด Lag Length ที่เหมาะสม	38

ลิขสิทธิ์ © โดย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright © by Chiang Mai University
 All Rights Reserved

4.4	ผลการวิเคราะห์ความเป็นเหตุเป็นผลตัวแปร Granger Causality Test	39
4.5	ผลวิเคราะห์ Impulse Response Function	41
4.6	ผลวิเคราะห์ Variance Decomposition	51
บทที่ 5	สรุปผลการศึกษา และข้อเสนอแนะ	
5.1	สรุปผลการศึกษา	57
5.2	ข้อเสนอแนะ	59
บรรณานุกรม		60
ภาคผนวก		
	ภาคผนวก ก กราฟข้อมูลเบื้องต้นที่นำมาศึกษา	62
	ภาคผนวก ข ผลการวิเคราะห์ Unit root Test	63
	ภาคผนวก ค ผลการทดสอบตัวแปร VAR Model	87
	ภาคผนวก ง การวิเคราะห์ Lag Length ที่เหมาะสม	88
	ภาคผนวก จ การวิเคราะห์ Granger Causality Test	89
	ภาคผนวก ฉ การวิเคราะห์ Impulse Response Function	90
	ภาคผนวก ช การวิเคราะห์ Variance Decomposition	98
ประวัติผู้เขียน		102

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
4.1.1 ผลการทดสอบ unit root test ของตัวแปรแต่ละตัวที่ระดับ Level	36
4.1.2 ผลการทดสอบ unit root test ของตัวแปรแต่ละตัวที่ First Difference	36
4.2.1 Graph ตัวแปรทั้ง 4 ตัว หลังจากการปรับฤดูกาล(Trend) เรียบร้อยแล้ว	37
4.3.1 ผลการวิเคราะห์ช่วงเวลาที่เหมาะสม (Lag Length)	38
4.4.1 การวิเคราะห์ Granger Causality Tests	40
4.5.1 กราฟผลการวิเคราะห์ Impulse Response Function ตัวแปรราคาหลักทรัพย์ ปตท.(PTT)	43
4.5.1 ตารางผลการวิเคราะห์ Impulse Response Function ตัวแปรราคาหลักทรัพย์ ปตท.(PTT)	44
4.5.2 กราฟผลการวิเคราะห์ Impulse Response Function ตัวแปรราคาน้ำมันดิบ ล่วงหน้าที่สหรัฐอเมริกา(NYMEX)	45
4.5.2 ตารางผลการวิเคราะห์ Impulse Response Function ตัวแปรราคาน้ำมันดิบ ล่วงหน้าที่สหรัฐอเมริกา(NYMEX)	46
4.5.3 กราฟผลการวิเคราะห์ Impulse Response Function ตัวแปรราคาน้ำมันดิบ ปัจจุบันที่ตลาดดูไบ(DUBAI)	47
4.5.3 ตารางผลการวิเคราะห์ Impulse Response Function ตัวแปรราคาน้ำมันดิบ ปัจจุบันที่ตลาดดูไบ(DUBAI)เชื่อมั่นของผู้บริโภค	48
4.5.4 กราฟผลการวิเคราะห์ Impulse Response Function ตัวแปรราคาน้ำมันดิบ ปัจจุบันสิงคโปร์(SIMEX)	49
4.5.4 ตารางผลการวิเคราะห์ Impulse Response Function ตัวแปรราคาน้ำมันดิบ ปัจจุบันสิงคโปร์(SIMEX)	50
4.6.1 ผลการวิเคราะห์ Variance Decomposition ตัวแปรราคาหลักทรัพย์ปตท. (PTT)	53
4.6.2 ผลการวิเคราะห์ Variance Decomposition ตัวแปรราคาน้ำมันดิบล่วงหน้า ที่สหรัฐอเมริกา(NYMEX)	54

- 4.6.3 ผลการวิเคราะห์ Variance Decomposition ตัวแปรราคาน้ำมันดิบปัจจุบันที่
ตลาดดูไบ(DUBAI) 55
- 4.6.4 ผลการวิเคราะห์ Variance Decomposition ของตัวแปรราคาน้ำมันดิบปัจจุบัน
ที่ตลาดสิงคโปร์(SIMEX) 56



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved