

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	๗
สารบัญภาพ	ถ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญ	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	11
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา	11
1.4 ขอบเขตของการศึกษา	12
บทที่ 2 ทฤษฎีและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	
2.1 ทฤษฎีและแนวคิดที่เกี่ยวข้อง	13
2.1.1 ทฤษฎีความเสมอภาคของอำนาจซื้อ (Purchasing Power Parity)	13
1) ทฤษฎีความเสมอภาคของอำนาจซื้อแบบสมบูรณ์	13
2) ทฤษฎีความเสมอภาคของอำนาจซื้อแบบเปรียบเทียบ	14
2.1.2 ทฤษฎีการส่งผ่านอัตราแลกเปลี่ยน (Exchange Rate Pass – Through)	16
2.1.3 ทฤษฎีการตั้งราคาสินค้า (Pricing-To-Market: PTM)	18
2.2 ทฤษฎีทางเศรษฐมิติ	22
2.2.1 การวิเคราะห์ข้อมูลอนุกรมเวลา (Time Series Analysis)	23
2.2.2 การทดสอบยูนิตรูท (Unit Root Test)	23
2.2.3 แบบจำลอง Autoregressive integrated moving average (ARIMA (p,d,q))	25

2.2.4	แบบจำลองความผันผวนแบบมีเงื่อนไขตัวแปรเดียว (Univariate Condition Volatility Models)	27
1)	พิจารณาความผันผวนแบบมีเงื่อนไขตัวแปรเดียว (Univariate Condition Volatility Models) จากแบบจำลอง Autoregressive Conditional Heteroskedasticity (ARCH)	27
2)	พิจารณาความผันผวนแบบมีเงื่อนไขตัวแปรเดียว (Univariate Condition Volatility Models) จากแบบจำลอง Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (GARCH)	29
2.2.5	เกณฑ์การเลือกรูปแบบของแบบจำลองที่ดีที่สุด (Model Selection)	30
2.2.6	แบบจำลองความผันผวนแบบมีเงื่อนไขหลายตัวแปร (Multivariate Conditional Volatility Models)	30
1)	พิจารณา Conditional Covariance จากแบบจำลอง Vector Autoregressive Moving Average-GARCH (VARMA-GARCH)	31
2)	พิจารณา Conditional Correlations จากแบบจำลอง Dynamic Conditional Correlation (DCC)	33
2.2	เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	35
บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย		
3.1	ข้อมูลและแหล่งข้อมูลที่ใช้ในการวิจัย	42
3.2	วิธีการวิจัย	42
3.2.1	การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root Test)	42
3.2.2	แบบจำลอง Autoregressive integrated moving average (ARIMA (p,d,q))	44
3.2.3	แบบจำลองความผันผวนแบบมีเงื่อนไขตัวแปรเดียว (Univariate Condition Volatility Models)	45
1)	พิจารณาความผันผวนแบบมีเงื่อนไขตัวแปรเดียว (Univariate Condition Volatility Models) จากแบบจำลอง Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity: GARCH (p,q)	45
3.2.4	เกณฑ์การเลือกรูปแบบของแบบจำลองที่ดีที่สุด (Model Selection)	47

3.2.5	แบบจำลองความผันผวนแบบมีเงื่อนไขหลายตัวแปร (Multivariate Conditional Volatility Models)	48
1)	พิจารณา Conditional Covariance จากแบบจำลอง Vector Autoregressive Moving Average-GARCH (VARMA-GARCH)	48
2)	พิจารณา Conditional Correlations จากแบบจำลอง Dynamic Conditional Correlation (DCC)	49
บทที่ 4 ผลการศึกษา		
4.1	ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root Test) โดยวิธี Augmented Dickey – Fuller test (ADF)	52
4.2	การประมาณแบบจำลอง Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA(p,d,q))	57
4.2.1	แบบจำลอง (ARIMA(p,d,q)) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์ออสเตรเลีย	57
4.2.2	แบบจำลอง (ARIMA(p,d,q)) ของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังออสเตรเลีย	58
4.2.3	แบบจำลอง (ARIMA(p,d,q)) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินเยน	59
4.2.4	แบบจำลอง (ARIMA(p,d,q)) ของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังญี่ปุ่น	60
4.2.5	แบบจำลอง (ARIMA(p,d,q)) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์สหรัฐ ฯ	61
4.2.6	แบบจำลอง (ARIMA(p,d,q)) ของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังสหรัฐ ฯ	62
4.3	แบบจำลองความผันผวนแบบมีเงื่อนไขตัวแปรเดียว (Univariate Condition Volatility Models)	63
4.3.1	พิจารณาความผันผวนแบบมีเงื่อนไขตัวแปรเดียว (Univariate Condition Volatility Models) จากแบบจำลอง Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity: GARCH (p,q)	63
1)	แบบจำลอง GARCH (p,q) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์ออสเตรเลีย	64

2) แบบจำลอง GARCH (p, q) ของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังออสเตรเลีย	66
3) แบบจำลอง GARCH (p, q) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินเยน	68
4) แบบจำลอง GARCH (p, q) ของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังญี่ปุ่น	70
5) แบบจำลอง GARCH (p, q) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อ เงินดอลลาร์สหรัฐ ฯ	72
6) แบบจำลอง GARCH (p, q) ของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังสหรัฐ ฯ	73
4.4 พิจารณาความผันผวนแบบมีเงื่อนไข (Conditional Volatility) จาก การประมาณแบบจำลองของ Multivariate GARCH	75
4.4.1 พิจารณา Conditional Covariance จากแบบจำลอง Vector Autoregressive Moving Average-GARCH (VARMA-GARCH)	75
1) แบบจำลอง (VARMA – GARCH) ของความสัมพันธ์ระหว่าง ความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงิน ดอลลาร์ออสเตรเลียและความผันผวนของมูลค่า การส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบ ของไทยไปยังออสเตรเลีย	76
2) แบบจำลอง (VARMA – GARCH) ของความสัมพันธ์ระหว่าง ความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินเยนและ ความผันผวนของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์ และส่วนประกอบของไทยไปยังญี่ปุ่น	83
3) แบบจำลอง (VARMA – GARCH) ของความสัมพันธ์ระหว่าง ความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์สหรัฐ ฯ และความผันผวนของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์ และส่วนประกอบของไทยไปยังสหรัฐ ฯ	89
4.4.2 พิจารณา Conditional Correlations จากแบบจำลอง Dynamic Conditional Correlation (DCC)	94
1) แบบจำลอง DCC ของความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของ อัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์ออสเตรเลียและ	

ความผันผวนของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์ และส่วนประกอบของไทยไปยังออสเตรเลีย	(H_t^{AUS})	95
2) แบบจำลอง DCC ของความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวน ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินเยนและความผันผวน ของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบ ของไทยไปยังญี่ปุ่น	(H_t^P)	97
3) แบบจำลอง DCC ของความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวน ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์สหรัฐ ฯ และ ความผันผวนของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์ และส่วนประกอบของไทยไปยังสหรัฐ ฯ	(H_t^{US})	99
บทที่ 5 สรุปผลการศึกษา และข้อเสนอแนะ		
5.1 สรุปผลการศึกษา		101
5.1.1 ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root Test) โดยวิธี Augmented Dickey –Fuller test (ADF)		102
5.1.2 การประมาณแบบจำลอง Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA(p,d,q))		102
5.1.2 แบบจำลองความผันผวนแบบมีเงื่อนไขตัวแปรเดียว (Univariate Condition Volatility Models)		103
1) ผลจากการพิจารณาความผันผวนแบบมีเงื่อนไขตัวแปรเดียว (Univariate Condition Volatility Models) จากแบบจำลอง Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity: GARCH (p,q)		103
5.1.3 แบบจำลองความผันผวนแบบมีเงื่อนไขหลายตัวแปร (Multivariate Conditional Volatility Models)		105
1) ผลจากการพิจารณา Conditional Covariance จากแบบจำลอง Vector Autoregressive Moving Average–GARCH (VARMA-GARCH)		105
2) ผลจากการพิจารณา Conditional Correlations จากแบบจำลอง Dynamic Conditional Correlation (DCC)		114

5.2	ข้อเสนอแนะเชิงนโยบาย	116
5.3	ข้อเสนอแนะในการทำการศึกษาล้างครั้งต่อไป	116
เอกสารอ้างอิง		118
ภาคผนวก		
ภาคผนวก ก	ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root Test) โดยวิธี Augmented Dickey – Fuller Test	122
ภาคผนวก ข	ผลการประมาณแบบจำลอง Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA(p,d,q))	140
ภาคผนวก ค	ผลการประมาณแบบจำลอง Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (GARCH(p,q))	146
ภาคผนวก ง	ผลการประมาณแบบจำลอง VARMA – GARCH(p,q) และ DCC	152
ประวัติผู้เขียน		158

สารบัญตาราง

ตาราง หน้า

1.1 แสดง มูลค่าสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์ และส่วนประกอบกับมูลค่าผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ ตั้งแต่ปี พ.ศ. 2543 – 2553	1
1.2 มูลค่าการนำเข้าสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของประเทศผู้นำเข้าสำคัญของโลก ตั้งแต่ปี 2548 – 2552	2
1.3 การส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังตลาดโลก ตั้งแต่ เดือน ก.ค. 2552 ถึง พ.ค. 2553	3
4.1 แสดงผลการทดสอบ Unit Root ข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยนและมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังออสเตรเลีย โดยวิธี Augmented Dickey – Fuller test (ADF) ณ ระดับ First difference or I(1)	53
4.2 แสดงผลการทดสอบ Unit Root ข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยนและมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยกับญี่ปุ่น โดยวิธี Augmented Dickey – Fuller test (ADF) ณ ระดับ First difference or I(1)	54
4.3 แสดงผลการทดสอบ Unit Root ข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยนและมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยกับสหรัฐอเมริกา โดยวิธี Augmented Dickey – Fuller test (ADF) ณ ระดับ First difference or I(1)	55
4.4 แบบจำลอง (ARIMA(p,d,q)) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์ออสเตรเลีย	57
4.5 แสดงผลการทดสอบ Breusch – Godfrey Serial Correlation LM ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์ออสเตรเลีย	58
4.6 แสดงผลการทดสอบ Lag p และ q ที่เหมาะสมสำหรับแบบจำลอง Autoregressive Integrated moving average (ARIMA(p,d,q)) ของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังออสเตรเลีย ((D(AUSX))	58
4.7 แสดงผลการทดสอบ Breusch – Godfrey Serial Correlation LM ของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังออสเตรเลีย	59

4.8	แสดงผลการทดสอบ Lag p และ q ที่เหมาะสมสำหรับแบบจำลอง Autoregressive Integrated moving average (ARIMA(p,d,q)) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินเยน ((D(JPE)))	59
4.9	แสดงผลการทดสอบ Breusch – Godfrey Serial Correlation LM ของอัตราแลกเปลี่ยนของเงินบาทต่อเงินเยน	60
4.10	แสดงผลการทดสอบ Lag p และ q ที่เหมาะสมสำหรับแบบจำลอง Autoregressive Integrated moving average (ARIMA(p,d,q)) ของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังญี่ปุ่น ((D(JPX)))	60
4.11	แสดงผลการทดสอบ Breusch – Godfrey Serial Correlation LM ของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังญี่ปุ่น	61
4.12	แสดงผลการทดสอบ Lag p และ q ที่เหมาะสมสำหรับแบบจำลอง Autoregressive Integrated moving average (ARIMA(p,d,q)) ของอัตราแลกเปลี่ยนของเงินบาทต่อเงินดอลลาร์สหรัฐ ฯ ((D(USDE)))	61
4.13	แสดงผลการทดสอบ Breusch – Godfrey Serial Correlation LM ของอัตราแลกเปลี่ยนของเงินบาทต่อเงินดอลลาร์สหรัฐ ฯ	62
4.14	แสดงผลการทดสอบ Lag p และ q ที่เหมาะสมสำหรับแบบจำลอง Autoregressive Integrated moving average (ARIMA(p,d,q)) ของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังสหรัฐ ฯ ((D(USDX)))	62
4.15	แสดงผลการทดสอบ Breusch – Godfrey Serial Correlation LM ของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังสหรัฐ ฯ	63
4.16	แสดงผลการประมาณแบบจำลอง GARCH (p,q) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์ออสเตรเลีย	64
4.17	แสดงผลการทดสอบ ARCH Effect ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์ออสเตรเลีย	65
4.18	แสดงผลการประมาณแบบจำลอง GARCH (p,q) ของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังออสเตรเลีย	66
4.19	แสดงผลการทดสอบ ARCH Effect ของจากมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังออสเตรเลีย	67
4.20	แสดงผลการประมาณแบบจำลอง GARCH (p,q) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินเยน	68

4.21	แสดงผลการทดสอบ ARCH Effect ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินเยน	69
4.22	แสดงผลการประมาณแบบจำลอง GARCH (p,q) ของมูลค่าการส่งออกสินค้า ยานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังญี่ปุ่น	70
4.23	แสดงผลการทดสอบ ARCH Effect ของจากมูลค่าการส่งออกสินค้า ยานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังญี่ปุ่น	71
4.24	แสดงผลการประมาณแบบจำลอง GARCH (p,q) ของอัตราแลกเปลี่ยน เงินบาทต่อเงินดอลลาร์สหรัฐ ฯ	72
4.25	แสดงผลการทดสอบ ARCH Effect ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อ เงินดอลลาร์สหรัฐ ฯ	73
4.26	แสดงผลการประมาณแบบจำลอง GARCH (p,q) ของมูลค่าการส่งออก สินค้านานาชาติ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังสหรัฐ ฯ	73
4.27	แสดงผลการทดสอบ ARCH Effect ของจากมูลค่าการส่งออกสินค้า ยานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังสหรัฐ ฯ	74
4.28	แสดงผลการทดสอบ VARMA – GARCH ของความสัมพันธ์ระหว่าง ความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์ออสเตรเลียและ ความผันผวนของมูลค่าการส่งออกสินค้านานาชาติ อุปกรณ์และส่วนประกอบของ ไทยไปยังออสเตรเลีย	76
4.29	แสดงผลการทดสอบ VARMA – GARCH(1,1)	78
4.30	ลำดับความสำคัญของตัวแปรที่มีอิทธิพลต่อการเปลี่ยนแปลงของความผันผวน แบบมีเงื่อนไขของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์ออสเตรเลีย	80
4.31	ลำดับความสำคัญของตัวแปรที่มีอิทธิพลต่อการเปลี่ยนแปลงของความผันผวน แบบมีเงื่อนไขของมูลค่าการส่งออกสินค้านานาชาติ อุปกรณ์และส่วนประกอบ ของไทยไปยังออสเตรเลีย	82
4.32	แสดงผลการทดสอบ VARMA – GARCH ของความสัมพันธ์ระหว่าง ความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินเยนและความผันผวน ของมูลค่าการส่งออกสินค้านานาชาติ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทย ไปยังญี่ปุ่น	83
4.33	แสดงผลการทดสอบ VARMA – GARCH(1,1)	85
4.34	ลำดับความสำคัญของตัวแปรที่มีอิทธิพลต่อการเปลี่ยนแปลงของ ความผันผวนแบบมีเงื่อนไขของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินเยน	86

- 4.35 ลำดับความสำคัญของตัวแปรที่มีอิทธิพลต่อการเปลี่ยนแปลงของ
ความผันผวนแบบมีเงื่อนไขของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์
อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังญี่ปุ่น 88
- 4.36 แสดงผลการทดสอบ VARMA – GARCH ของความสัมพันธ์ระหว่าง
ความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์สหรัฐ ฯ
และความผันผวนของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และ
ส่วนประกอบของไทยไปยังสหรัฐ ฯ 89
- 4.37 แสดงผลการทดสอบ VARMA – GARCH(1,1) 90
- 4.38 ลำดับความสำคัญของตัวแปรที่มีอิทธิพลต่อการเปลี่ยนแปลงของความผันผวน
แบบมีเงื่อนไขของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์สหรัฐ ฯ 92
- 4.39 ลำดับความสำคัญของตัวแปรที่มีอิทธิพลต่อการเปลี่ยนแปลงของความผันผวน
แบบมีเงื่อนไขของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบ
ของไทยไปยังสหรัฐ ฯ 93
- 4.40 แสดงค่าสัมประสิทธิ์ (θ_1, θ_2) ของทั้ง DCC (1) และ DCC (2) โดยแบบจำลอง
DCC ของความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อ
เงินดอลลาร์ออสเตรเลียและความผันผวนของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์
อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังออสเตรเลีย 95
- 4.41 แสดงค่าสัมประสิทธิ์ (θ_1, θ_2) ของทั้ง DCC (1) และ DCC (2) โดยแบบจำลอง
DCC ของความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อ
เงินเยนและความผันผวนของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และ
ส่วนประกอบของไทยไปยังญี่ปุ่น 97
- 4.42 แสดงค่าสัมประสิทธิ์ (θ_1, θ_2) ของทั้ง DCC (1) และ DCC (2) โดยแบบจำลอง
DCC ของความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อ
เงินดอลลาร์สหรัฐ ฯ และความผันผวนของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์
อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังสหรัฐ ฯ 99
- 5.1 ลำดับความสำคัญของตัวแปรที่มีอิทธิพลต่อการเปลี่ยนแปลงของความผันผวน
แบบมีเงื่อนไขของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์ออสเตรเลีย 106
- 5.2 ลำดับความสำคัญของตัวแปรที่มีอิทธิพลต่อการเปลี่ยนแปลงของความผันผวน
แบบมีเงื่อนไขของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบ
ของไทยไปยังออสเตรเลีย 107

5.3 ลำดับความสำคัญของตัวแปรที่มีอิทธิพลต่อการเปลี่ยนแปลงของความผันผวน แบบมีเงื่อนไขของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินเยน	109
5.4 ลำดับความสำคัญของตัวแปรที่มีอิทธิพลต่อการเปลี่ยนแปลงของความผันผวน แบบมีเงื่อนไขของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบ ของไทยไปยังญี่ปุ่น	110
5.5 ลำดับความสำคัญของตัวแปรที่มีอิทธิพลต่อการเปลี่ยนแปลงของความผันผวน แบบมีเงื่อนไขของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์สหรัฐ ฯ	111
5.6 ลำดับความสำคัญของตัวแปรที่มีอิทธิพลต่อการเปลี่ยนแปลงของความผันผวน แบบมีเงื่อนไขของมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบ ของไทยไปยังสหรัฐ ฯ	112

สารบัญภาพ

รูป หน้า

1.1	สัดส่วนสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์ และส่วนประกอบต่อมูลค่าผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ ตั้งแต่ปี พ.ศ. 2543 - 2553	1
1.2	แสดงมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังประเทศ ออสเตรเลีย แบบรายเดือน ตั้งแต่ ม.ค. 2540 ถึง เม.ย. 2553	4
1.3	แสดงอัตราแลกเปลี่ยนของเงินบาทไทยต่อเงินดอลลาร์ของออสเตรเลีย ตั้งแต่ ม.ค. 2540 ถึง เม.ย. 2553	5
1.4	แสดงมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังประเทศญี่ปุ่น แบบรายเดือน ตั้งแต่ ม.ค. 2540 ถึง เม.ย. 2553	6
1.5	แสดงอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทไทยต่อเงินเยนของญี่ปุ่น ตั้งแต่ ม.ค. 2540 ถึง เม.ย. 2553	6
1.6	แสดงมูลค่าการส่งออกสินค้ายานยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของไทยไปยังประเทศสหรัฐฯ แบบรายเดือน ตั้งแต่ ม.ค. 2540 ถึง เม.ย. 2553	8
1.7	แสดงอัตราแลกเปลี่ยนของเงินบาทไทยต่อเงินดอลลาร์ของสหรัฐฯ ตั้งแต่ ม.ค. 2540 ถึง เม.ย. 2553	8