

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ญ
สารบัญภาพ	ฎ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	7
1.3 ขอบเขตของการศึกษา	7
1.4 แหล่งที่มาของข้อมูล	8
1.5 ประโยชน์ที่ได้รับจากการศึกษา	8
บทที่ 2 ทฤษฎีและผลงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	
2.1 ทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง	9
2.1.1 ทฤษฎีบทข้อมูลอนุกรมเวลา	9
2.1.2 การทดสอบการร่วมกันไปด้วยกัน	10
2.1.3 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล และการทดสอบ Unit Root	11
2.1.4 การเลือก lag length ในการทดสอบ	14
2.1.5 แนวคิดเกี่ยวกับความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพในระยะสั้น	14
2.2 เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	15

บทที่ 3	ระเบียบวิธีวิจัย	
3.1	การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root Test)	23
3.2	การวิเคราะห์ความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพในระยะยาว	24
3.3	การทดสอบ Error Correction Mechanism : (ECM)	25
3.4	การทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล (Granger Causality)	27
บทที่ 4	ผลการศึกษา	
4.1	ผลการทดสอบยูนิทรูท (Unit Root Test)	31
4.2	ผลการวิเคราะห์ความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพในระยะยาว	39
4.3	ผลการวิเคราะห์ความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพในระยะสั้น	51
4.4	ผลการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล (Granger Causality)	59
บทที่ 5	สรุปผลการศึกษา	
5.1	สรุปผลการศึกษา	64
5.2	ข้อเสนอแนะ	66
	เอกสารอ้างอิง	67
	ภาคผนวก	
	ภาคผนวก ตารางผลการคำนวณจากโปรแกรม Eviews	70
	ประวัติผู้เขียน	120

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
4.1 ผลการทดสอบความนิ่ง (Unit root test) ของข้อมูลราคาน้ำมันดิบในตลาดโลก	29
4.2 ผลการทดสอบความนิ่ง (Unit root test) ของข้อมูลดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET Index)	30
4.3 ผลการทดสอบความนิ่ง (Unit root test) ของข้อมูลดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์สหรัฐอเมริกา (Nasdaq)	31
4.4 ผลการทดสอบความนิ่ง (Unit root test) ของข้อมูลดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์สหรัฐอเมริกา (Dow Jones)	32
4.5 ผลการทดสอบความนิ่ง (Unit root test) ของข้อมูล ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ฮ่องกง (Hang Seng)	33
4.6 ผลการทดสอบความนิ่ง (Unit root test) ของข้อมูลดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ประเทศสิงคโปร์ (Straits Times)	34
4.7 ผลการทดสอบความนิ่ง (Unit root test) ของข้อมูล ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ประเทศญี่ปุ่น (Nikkei)	35
4.8 ผลการทดสอบ Cointegration และ Unit Root ของส่วนที่เหลือ (Residuals) กรณีดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ที่สำคัญเป็นตัวแปรอิสระและราคาน้ำมันดิบในตลาดโลก เป็นตัวแปรตาม	37
4.9 ผลการทดสอบ Cointegration และ Unit Root ของส่วนที่เหลือ (residuals) กรณีราคาน้ำมันดิบในตลาดโลกเป็นตัวแปรอิสระและดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ที่สำคัญเป็นตัวแปรตาม	43
4.10 ผลการทดสอบการวิเคราะห์เชิงดุลยภาพในระยะสั้นตามแบบจำลอง ECM กรณีดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ที่สำคัญเป็นตัวแปรอิสระและราคาน้ำมันดิบในตลาดโลก เป็นตัวแปรตาม	49
4.11 ผลการทดสอบการวิเคราะห์เชิงดุลยภาพในระยะสั้นตามแบบจำลอง ECM กรณีราคาน้ำมันดิบในตลาดโลกเป็นตัวแปรอิสระและดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ที่สำคัญ เป็นตัวแปรตาม	53
4.12 ผลการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล (Granger Causality Test)	57

สารบัญภาพ

รูป		หน้า
1.1	การบริโภคน้ำมันในประเทศสหรัฐอเมริกา	3
1.2	การบริโภคน้ำมันในประเทศไทย	3
1.3	การบริโภคน้ำมันในประเทศสิงคโปร์	4
1.4	การบริโภคน้ำมันในประเทศญี่ปุ่น	4
1.5	การบริโภคน้ำมันในประเทศเกาหลี	5
1.6	ราคาน้ำมันดิบในตลาดโลก	6

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright© by Chiang Mai University
 All rights reserved