

## สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ญ
สารบัญภาพ	ฎ
สารบัญตารางภาคผนวก	ฏ
สารบัญภาพภาคผนวก	ณ
<b>บทที่ 1 บทนำ</b>	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	6
1.3 ประโยชน์ที่จะได้รับจากการศึกษา	6
1.4 ขอบเขตการศึกษา	7
1.5 นิยามศัพท์	8
<b>บทที่ 2 กรอบแนวคิดทางทฤษฎีและเอกสารที่เกี่ยวข้อง</b>	
2.1 กรอบแนวคิดทางทฤษฎี	9
2.1.1 แนวคิดทฤษฎีอุปสงค์	9
2.1.2 เศรษฐศาสตร์ขนส่ง	10
2.1.3 การชำระเงินระหว่างประเทศ	17
2.1.4 กรอบแนวคิดทฤษฎีในการวิเคราะห์ทางเศรษฐมิติ	21
2.2 เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	38
<b>บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย</b>	
3.1 กรอบแนวคิด	41
3.2 ข้อมูลที่ใช้ศึกษา	41
3.3 แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา	41
3.4 สมมติฐานของการวิจัย	42

3.5	วิธีการศึกษา	43
3.5.1	การทดสอบ Unit root	44
3.5.2	การเลือกความล่าช้า (Lag) ที่เหมาะสม	46
3.5.3	การทดสอบ Cointegration วิธีของ Johansen	46
3.5.4	แบบจำลอง Vector Autoregression	48
บทที่ 4	ผลการศึกษา	
4.1	ผลการทดสอบ Unit root	51
4.2	ผลการทดสอบและเลือกความล่าช้า	55
4.3	การทดสอบความสัมพันธ์เชิงคู่ภาพในระยะยาว	56
4.4	การประมาณค่าแบบจำลอง VAR และผลการทดสอบ Stability	58
4.5	ผลการวิเคราะห์ปฏิกิริยาตอบสนองต่อความแปรปรวน	64
4.6	ผลการวิเคราะห์การแยกส่วนของความแปรปรวน	69
บทที่ 5	บทสรุป และข้อเสนอแนะ	
5.1	สรุปผลการศึกษา	72
5.2	ข้อเสนอแนะเชิงนโยบาย	75
5.2	ข้อเสนอแนะในการศึกษาครั้งต่อไป	76
	เอกสารอ้างอิง	77
	ภาคผนวก	81
	ประวัติผู้เขียน	130

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า	
1.1	มูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรหมวดยางพาราและข้าว พ.ศ. 2545 - 2553	2
1.2	แสดงอัตราค่าเช่าตามขนาดของเรือ	4
4.1	แสดงผลการทดสอบ Unit root โดยวิธี Dickey – Fuller test statistics ในระดับ Level	52
4.2	แสดงผลการทดสอบ Unit root โดยวิธี Augmented Dickey – Fuller test statistics: Modified SIC ในระดับ Level	53
4.3	แสดงผลการทดสอบ Unit root โดยวิธี Phillips – Perron test ในระดับ Level	54
4.4	แสดงผลการเลือกความล่าช้าของการศึกษา การเปลี่ยนแปลงของมูลค่าข้าวส่งออกกับการเปลี่ยนแปลงของปัจจัยทางเศรษฐกิจ	55
4.5	แสดงผลการเลือกความล่าช้าของการศึกษา การเปลี่ยนแปลงมูลค่ายางพารากับการเปลี่ยนแปลงของปัจจัยทางเศรษฐกิจ	56
4.6	แสดงผลการทดสอบ Cointegration ของ Johansen ในส่วนของ GRICE	57
4.7	แสดงผลการทดสอบ Cointegration ของ Johansen ในส่วนของ GRUBBER	57
4.8	แสดงผลการประมาณค่าแบบจำลอง VAR ในส่วนของ GRICE	58
4.9	แสดงผลการประมาณค่าแบบจำลอง VAR ในส่วนของ GRUBBER	60
4.10	แสดงผลการทดสอบ VAR Stability Condition check Roots of Characteristic Polynomial ในส่วนของ GRICE	62
4.11	แสดงผลการทดสอบ VAR Stability Condition check Roots of Characteristic Polynomial ในส่วนของ GRUBBER	63
4.12	ผลการวิเคราะห์แยกส่วนความแปรปรวนของมูลค่าการเปลี่ยนแปลงของมูลค่าข้าวส่งออก	69
4.13	ผลการวิเคราะห์แยกส่วนความแปรปรวนของมูลค่าการเปลี่ยนแปลงของมูลค่ายางพารา	70

## สารบัญภาพ

รูป	หน้า
1.1 แสดงปริมาณขนส่งสินค้าระหว่างประเทศ แยกตามรูปแบบการขนส่ง ปี 2550 – 2552	3
2.1 ต้นทุนระยะสั้นและระยะยาวของการขนส่งทางเรือ	16
4.1 การทดสอบ VAR Stability โดยการแสดงรูปวงกลมรัศมีหนึ่งหน่วย (GRICE)	62
4.2 การทดสอบ VAR Stability โดยการแสดงรูปวงกลมรัศมีหนึ่งหน่วย (GRUBBER)	63
4.3 แสดงผลการวิเคราะห์ห้ปฏิกิริยาตอบสนองต่อความแปรปรวน (Impulse Response Function) ของ GRICE กับ GBDI	64
4.4 แสดงผลการวิเคราะห์ห้ปฏิกิริยาตอบสนองต่อความแปรปรวน (Impulse Response Function) ของ GRICE กับ GECH	65
4.5 แสดงผลการวิเคราะห์ห้ปฏิกิริยาตอบสนองต่อความแปรปรวน (Impulse Response Function) ของ GRICE กับ GOIL	66
4.6 แสดงผลการวิเคราะห์ห้ปฏิกิริยาตอบสนองต่อความแปรปรวน (Impulse Response Function) ของ GRUBBER กับ GBDI	66
4.7 แสดงผลการวิเคราะห์ห้ปฏิกิริยาตอบสนองต่อความแปรปรวน (Impulse Response Function) ของ GRUBBER กับ GECH	67
4.8 แสดงผลการวิเคราะห์ห้ปฏิกิริยาตอบสนองต่อความแปรปรวน (Impulse Response Function) ของ GRUBBER กับ GOIL	68

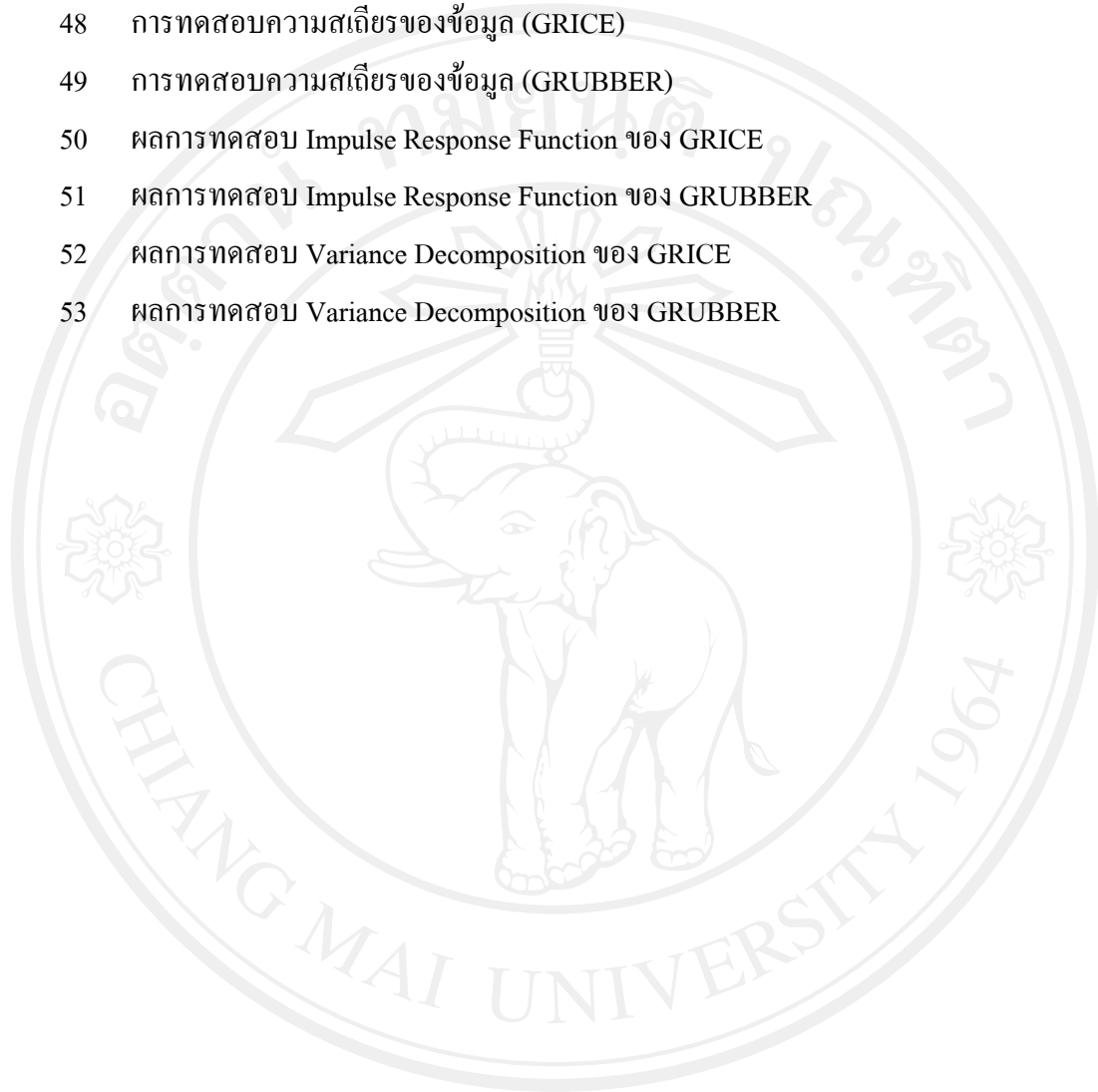
สารบัญตารางภาคผนวก

ตารางภาคผนวก	หน้า
1 แสดงข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	82
2 ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Dickey – Fuller test ของตัวแปร GBDI แบบจำลอง Intercept (At Level)	88
3 ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Dickey – Fuller test ของตัวแปร GBDI แบบจำลอง Intercept and trend (At Level)	89
4 ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Dickey – Fuller test ของตัวแปร GOIL แบบจำลอง Intercept (At Level)	89
5 ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Dickey – Fuller test ของตัวแปร GOIL แบบจำลอง Intercept and trend (At Level)	90
6 ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Dickey – Fuller test ของตัวแปร GECH แบบจำลอง Intercept (At Level)	91
7 ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Dickey – Fuller test ของตัวแปร GECH แบบจำลอง Intercept and trend (At Level)	91
8 ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Dickey – Fuller test ของตัวแปร GRICE แบบจำลอง Intercept (At Level)	92
9 ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Dickey – Fuller test ของตัวแปร GRICE แบบจำลอง Intercept and trend (At Level)	93
10 ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Dickey – Fuller test ของตัวแปร GRUBBER แบบจำลอง Intercept (At Level)	94
11 ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Dickey – Fuller test ของตัวแปร GRUBBER แบบจำลอง Intercept and trend (At Level)	94
12 ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey – Fuller test ของตัวแปร GBDI แบบจำลอง Intercept (At Level)	95
13 ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey – Fuller test ของตัวแปร GBDI แบบจำลอง Intercept and trend (At Level)	95

14	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey – Fuller test ของตัวแปร GBDI แบบจำลอง None (At Level)	96
15	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey – Fuller test ของตัวแปร GOIL แบบจำลอง Intercept (At Level)	97
16	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey – Fuller test ของตัวแปร GOIL แบบจำลอง Intercept and trend (At Level)	97
17	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey – Fuller test ของตัวแปร GOIL แบบจำลอง None (At Level)	98
18	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey – Fuller test ของตัวแปร GECH แบบจำลอง Intercept (At Level)	99
19	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey – Fuller test ของตัวแปร GECH แบบจำลอง Intercept and trend (At Level)	100
20	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey – Fuller test ของตัวแปร GECH แบบจำลอง None (At Level)	100
21	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey – Fuller test ของตัวแปร GRICE แบบจำลอง Intercept (At Level)	101
22	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey – Fuller test ของตัวแปร GRICE แบบจำลอง Intercept and trend (At Level)	102
23	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey – Fuller test ของตัวแปร GRICE แบบจำลอง None (At Level)	102
24	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey – Fuller test ของตัวแปร GRUBBER แบบจำลอง Intercept (At Level)	103
25	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey – Fuller test ของตัวแปร GRUBBER แบบจำลอง Intercept and trend (At Level)	104
26	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Augmented Dickey – Fuller test ของตัวแปร GRUBBER แบบจำลอง None (At Level)	104
27	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Phillips Perron test ของตัวแปร GBDI แบบจำลอง Intercept (At Level)	105
28	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธี Phillips Perron test ของตัวแปร GBDI แบบจำลอง Intercept and trend (At Level)	106

29	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธีPhillips Perron test ของตัวแปร GBDI แบบจำลอง None (At Level)	106
30	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธีPhillips Perron test ของตัวแปร GOILแบบจำลอง Intercept (At Level)	107
31	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธีPhillips Perron test ของตัวแปร GOIL แบบจำลอง Intercept and trend (At Level)	108
32	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธีPhillips Perron test ของตัวแปร GOIL แบบจำลอง None (At Level)	108
33	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธีPhillips Perron test ของตัวแปร GECHแบบจำลอง Intercept (At Level)	109
34	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธีPhillips Perron test ของตัวแปร GECH แบบจำลอง Intercept and trend (At Level)	110
35	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธีPhillips Perron test ของตัวแปร GECH แบบจำลอง None (At Level)	111
36	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธีPhillips Perron test ของตัวแปร GRICE แบบจำลอง Intercept (At Level)	111
37	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธีPhillips Perron test ของตัวแปร GRICE แบบจำลอง Intercept and trend (At Level)	112
38	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธีPhillips Perron test ของตัวแปร GRICE แบบจำลอง None (At Level)	113
39	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธีPhillips Perron test ของตัวแปร GRUBBER แบบจำลอง Intercept (At Level)	113
40	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธีPhillips Perron test ของตัวแปร GRUBBER แบบจำลอง Intercept and trend (At Level)	114
41	ผลการทดสอบ Unit root ด้วยวิธีPhillips Perron test ของตัวแปร GRUBBER แบบจำลอง None (At Level)	115
42	Determining Lag Length (Rice)	116
43	Determining Lag Length (Rubber)	116
44	Cointegration Rank Test (Trace) of GRICE	117
45	Cointegration Rank Test (Trace) of GRUBBER	118

46	Estimation Vector Regression (VAR) of GRICE	120
47	Estimation Vector Regression (VAR) of GRUBBER	121
48	การทดสอบความเสถียรของข้อมูล (GRICE)	122
49	การทดสอบความเสถียรของข้อมูล (GRUBBER)	123
50	ผลการทดสอบ Impulse Response Function ของ GRICE	123
51	ผลการทดสอบ Impulse Response Function ของ GRUBBER	125
52	ผลการทดสอบ Variance Decomposition ของ GRICE	126
53	ผลการทดสอบ Variance Decomposition ของ GRUBBER	128

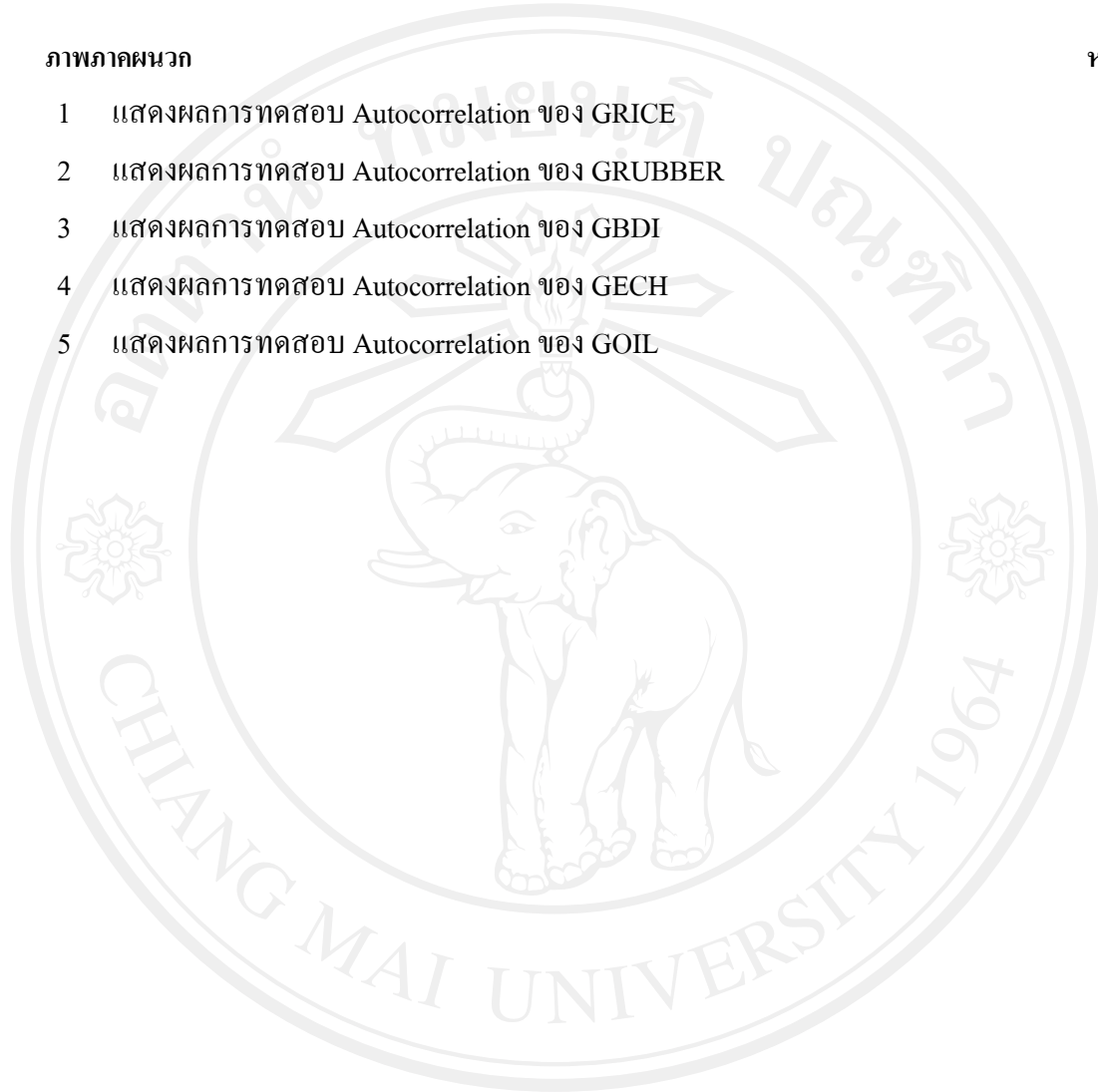


ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
 Copyright© by Chiang Mai University  
 All rights reserved



สารบัญภาพภาคผนวก

ภาพภาคผนวก	หน้า
1 แสดงผลการทดสอบ Autocorrelation ของ GRICE	86
2 แสดงผลการทดสอบ Autocorrelation ของ GRUBBER	86
3 แสดงผลการทดสอบ Autocorrelation ของ GBDI	87
4 แสดงผลการทดสอบ Autocorrelation ของ GECH	87
5 แสดงผลการทดสอบ Autocorrelation ของ GOIL	88



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
Copyright© by Chiang Mai University  
All rights reserved