สารบาญ

หน้า

กิตติกรรมประกาศ ค
บทคัดย่อภาษาไทย ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ ฉ
สารบาญตาราง ญ
สารบาญภาพ ฎ
สารบาญตารางภาคผนวก ฏ
สารบาญภาพภาคผนวก ฐ

บทที่ 1 บทนำ
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา 1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา 6
1.3 ขอบเขตของการศึกษา 6
1.4 ประโยชน์ที่จะได้รับจากการศึกษา 6
1.5 นิยามศัพท์ 7

บทที่ 2 ทฤษฎีและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง
2.1 ทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง
2.2.1 ทฤษฎีการค้าระหว่างประเทศ 8
2.2.2 แนวคิดเรื่องประโยชน์ที่ได้จากการค้าระหว่างประเทศ 9
2.1.3 การคำนวณรายได้ประชาชาติทางด้านรายจ่าย10
2.1.4 ทฤษฎีความเสมอภาคแห่งอำนาจซื้อ 10
2.1.5 อนุกรมเวลาและแบบจำลอ 12
2.2 เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง 14

บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย
3.1 กรอบแนวความคิด 18

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

3.2 วิธีการวิจัย 19
3.2.1 สมการในการศึกษา 19
3.2.2 แบบจำลองในการศึกษา 20
3.2.3 ขั้นตอนการศึกษา 20
3.3 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา 21

บทที่ 4 ผลการศึกษา
4.1 การทดสอบสมมติฐานความนิ่งของข้อมูล (unit root test) 22
4.2 การพิจารณาเลือกค่าความล่าช้าที่เหมาะสม (lag length) 25
4.3 การทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพในระยะยาว (cointegration) 26
4.4 การประมาณค่าแบบจำลอง VARs 26
4.5 การทดสอบคุณสมบัติความเสถียร (stationary) ของตัวแปรในแบบจำลอง 32
4.6 การวิเคราะห์ปฏิกิริยาตอบสนองต่อความแปรปรวน 34

บทที่ 5 สรุปผลการศึกษา
5.1 สรุปผลการศึกษา 36
5.2 ข้อเสนอแนะ 38

เอกสารอ้างอิง 39

ภาคผนวก
ภาคผนวก ก ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล (unit root test) 42
ภาคผนวก ข ผลการวิเคราะห์เลือกความล่าช้า (lag) ที่เหมาะสม 67
ภาคผนวก ค ผลการทดสอบคุณสมบัติเต็มระดับขั้น (full rank) 68
ภาคผนวก ง ผลการประมาณค่าแบบจำลอง VARs 69
ภาคผนวก จ การทดสอบคุณสมบัติ stationary ของตัวแปรในแบบจำลอง 71
ภาคผนวก ฉ ผลการวิเคราะห์ปฏิกิริยาตอบสนองความแปรปรวน 72

ประวัติผู้เขียน 73

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบาญตาราง

ตาราง		หน้า
1.1	แสดงอันดับคู่ค้าที่สำคัญของประเทศไทย (พ.ศ. 2553)	5
1.2	แสดงการลงทุนโดยตรงสุทธิจากต่างประเทศของประเทศไทย (ก.ค.-ธ.ค. 2553)	5
4.1	ผลยูนิทรูทข้อมูลดัชนีการเปิดประเทศของประเทศไทยกับจีน ด้วยวิธี ADF	23
4.2	ผลยูนิทรูทข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงของเงินบาทเทียบหยวน ด้วยวิธี ADF	23
4.3	ผลยูนิทรูทข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงของเงินบาทเทียบดอลลาร์ ด้วยวิธี ADF	23
4.4	ผลยูนิทรูทข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงของเงินบาทเทียบยูโร ด้วยวิธี ADF	24
4.5	ผลยูนิทรูทข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงของเงินบาทเทียบปอนด์ ด้วยวิธี ADF	24
4.6	ผลยูนิทรูทข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงของเงินบาทเทียบเยน ด้วยวิธี ADF	24
4.7	ผลการทดสอบความล่าช้า (lag length) ที่เหมาะสม	25
4.8	ผลทดสอบ cointegration test โดยวิธี Johansen	26
4.9	ผลการประมาณค่าด้วยแบบจำลอง VARs	27
4.10	ผลการทดสอบคุณสมบัติ stationary ของตัวแปรในแบบจำลอง	32

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบาญภาพ

รูป		หน้า
1.1	แสดงมูลค่าการนำเข้า การส่งออก และดุลการค้าของไทย (พ.ศ.2542-2453)	2
1.2	แสดงมูลค่าการค้าระหว่างไทยกับจีน การนำเข้าจากจีน การส่งออกไปจีน และGDP ของประเทศไทย(พ.ศ. 2537-2553)	3
1.3	แสดงอัตราการเปิดประเทศของประเทศไทยกับจีน (พ.ศ. 2537-2553)	4
4.1	แสดงผลการทดสอบคุณสมบัติ stationary ของตัวแปรในแบบจำลอง	33
4.2	แสดงผลการวิเคราะห์ปฏิกิริยาตอบสนองของตัวแปร	35

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบาญตารางภาคผนวก

ตารางภาคผนวก			หน้า
1	ก	การทดสอบ unit root ด้วยวิธี ADF ของตัวแปรดัชนีการเปิดประเทศของประเทศไทยกับประเทศจีน	42
2	ก	การทดสอบ unit root ด้วย ADF ของตัวแปรอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงของเงินบาทเทียบเงินหยวน	46
3	ก	การทดสอบ unit root ด้วยวิธี ADF ของตัวแปรอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงของเงินบาทเทียบเงินดอลลาร์	51
4	ก	การทดสอบ unit root ด้วยวิธี ADF ของตัวแปรอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงของเงินบาทเทียบเงินยูโร	55
5	ก	การทดสอบ unit root ด้วยวิธี ADF ของตัวแปรอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงของเงินบาทเทียบเงินปอนด์	59
6	ก	การทดสอบ unit root ด้วยวิธี ADF ของตัวแปรอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงของเงินบาทเทียบเงินเยน	63
7	ข	การวิเคราะห์เลือกความล่าช้า (lag length) ที่เหมาะสม	67
8	ค	การทดสอบการเต็มระดับขั้น (full rank)	68
9	ง	การประมาณค่าแบบจำลอง VARs	69
10	จ	การทดสอบคุณสมบัติ stationary ของตัวแปรในแบบจำลอง	71

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบาญภาพภาคผนวก

ภาพภาคผนวก			หน้า
1	จ	การทดสอบคุณสมบัติ stationary ของตัวแปรในแบบจำลอง	71
2	ฉ	การวิเคราะห์ปฏิกิริยาตอบสนอง	75

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved