

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ญ
สารบัญภาพ	ฎ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	7
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา	7
1.4 ขอบเขตการศึกษา	7
1.5 นิยามศัพท์	7
บทที่ 2 ทฤษฎีที่เกี่ยวข้องและวรรณกรรมปริทรรศน์	
2.1 ทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง	
2.1.1 แนวคิดทางความเสมอภาคในอำนาจซื้อ (Purchasing Power Parity Theory)	9
2.1.2 Interest Rate Parity theory of exchange rates	13
2.1.3 ทฤษฎี Exchange Rate and Tariff Pass-through	14
2.1.4 การตั้งราคาสินค้า (Pricing-to-market : PTM)	15
2.2 ทฤษฎีการวิเคราะห์ทางเศรษฐมิติ	19
2.2.1 การวิเคราะห์ข้อมูลอนุกรมเวลา (Time Series Analysis)	19
2.2.2 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล โดยการทดสอบยูนิตรุต (Unit Root Test)	19
2.2.3 แบบจำลอง ARIMA	21
2.2.4 แบบจำลอง ARCH	23
2.2.5 แบบจำลอง GARCH	25
2.2.6 แบบจำลอง Vector Autoregression (VAR)	26

2.2.7 การวิเคราะห์ Impulse Response Function	28
2.3 วรรณกรรมที่เกี่ยวข้อง	30
บทที่ 3 วิธีการศึกษา	
3.1 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root Test)	33
3.2 วิเคราะห์แบบจำลอง ARIMA(p,d,q)	33
3.3 การทดสอบความผันผวนอย่างมีเงื่อนไข (conditional variance)	34
3.4 การวิเคราะห์โดยใช้แบบจำลอง VAR	35
3.5 การวิเคราะห์ Impulse Response Function	37
บทที่ 4 ผลการศึกษา	
4.1 ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root Test)	39
4.2 ผลการทดสอบแบบจำลองที่เหมาะสมโดยใช้แบบจำลอง ARIMA (p,d,q)	41
4.3 ผลการทดสอบความผันผวนอย่างมีเงื่อนไขโดยใช้แบบจำลอง GARCH (p,q)	42
4.4 ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูลความผันผวนของตัวแปร (Unit Root Test)	44
4.5 ผลการทดสอบ VAR Lag Order Selection Criteria	45
4.6 ผลการทดสอบ Vector Autoregressive	46
4.7 ผลการทดสอบ Impulse Response Function	49
บทที่ 5 สรุปผลการศึกษาและข้อเสนอแนะ	
5.1 สรุปผลการศึกษา	53
5.2 ข้อเสนอแนะ	55
เอกสารอ้างอิง	56
ประวัติผู้เขียน	58

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
4.1 ผลการทดสอบ unit root ของอัตราแลกเปลี่ยน อัตราดอกเบี้ย ระดับราคาสินค้า ดุลการค้า การลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศ และผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ ซึ่งอยู่ในรูปลอการิทึม ด้วยวิธี Augmented Dickey-Fuller	40
4.2 ผลการประมาณแบบจำลอง ARIMA ของอัตราแลกเปลี่ยน (Exchange Rate: E) อัตราดอกเบี้ย (Interest Rate: R) และระดับราคาสินค้า (Price level: P)	42
4.3 ผลการประมาณแบบจำลอง GARCH(p,q) ของอัตราแลกเปลี่ยน (Exchange Rate: E) อัตราดอกเบี้ย (Interest Rate: R) และระดับราคาสินค้า (Price level: P)	43
4.4 ผลการทดสอบ unit root ของความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยน ความผันผวนของ อัตราดอกเบี้ย ความผันผวนของระดับราคาสินค้า ด้วยวิธี Augmented Dickey-Fuller	44
4.5 แสดงค่า VAR Lag Order Selection Criteria	45
4.6 ผลการทดสอบ Vector Autoregressive	46

สารบัญภาพ

รูป	หน้า
1.1 สัดส่วนมูลค่าสินค้าออกต่อผลผลิตมวลรวมภายในประเทศ ณ ปีฐาน ระหว่างปี พ.ศ. 2540 ถึง ปี พ.ศ. 2553	2
1.2 อัตราแลกเปลี่ยนของเงินบาทเมื่อเทียบกับดอลลาร์ สรอ. ระหว่างปี พ.ศ. 2540 ถึง ปี พ.ศ. 2553	3
1.3 การลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศ (Foreign Direct Investment) รายปีระหว่างปี พ.ศ. 2540 ถึง ปี พ.ศ. 2553	4
1.4 การเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยนอ้างอิงเงินบาทต่อดอลลาร์ สรอ. และดุลการค้ารายไตรมาส ระหว่างปี พ.ศ. 2540 ถึง ปี พ.ศ. 2553	5
2.1 แสดงทฤษฎีความเสมอภาคของอำนาจซื้อ	11
4.1 แสดงผล Impulse Response Function สำหรับแบบจำลอง VAR	52