

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	น
สารบัญตาราง	ภู
สารบัญภาพ	ภิ
บทที่ 1 บทนำ	1
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	4
1.3 ขอบเขตของการศึกษา	4
1.4 ประโยชน์ของการศึกษา	4
1.5 นิยามศัพท์	5
บทที่ 2 วรรณกรรมปริทัศน์	6
2.1 งานศึกษาในต่างประเทศ	6
2.1.1 การวิเคราะห์ปรากฏการณ์เส้นโค้งรูปตัวเจ	7
2.1.2 การวิเคราะห์เงื่อนไขของมาร์แซล-เดินเนอร์	12
2.2 งานศึกษาในประเทศไทย	16
บทที่ 3 แนวคิดและทฤษฎี	25
3.1 กระบวนการด้านความยืดหยุ่นที่มีต่อคุณการค้า	25
3.1.1 เงื่อนไขของมาร์แซล-เดินเนอร์	26
3.1.2 ปรากฏการณ์เส้นโค้งรูปตัวเจ	30
3.2 กระบวนการด้านการคุกซันในระบบเศรษฐกิจที่มีต่อคุณการค้า	31
3.3 แนวคิดเกี่ยวกับคุณการค้า	34
3.3.1 บทบาทของอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงที่มีต่อคุณการค้า	39
3.4 แนวคิดและวิธีการทางเศรษฐกิจ	42
3.4.1 การทดสอบคุณสมบัติ Stationary ของข้อมูลอนุกรมเวลา	42

3.4.2 แนวคิดเกี่ยวกับ Cointegration และ Error Correction Mechanisms	45
3.4.3 เทคนิคการประมาณ ARDL และ ECM	48
บทที่ 4 ระเบียบวิธีการวิจัย	54
4.1 ข้อมูลและแหล่งข้อมูล	54
4.2 แบบจำลองและสมมติฐานที่ใช้ในการศึกษา	56
4.2.1 แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา	56
4.2.2 การคำนวณอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงในแบบจำลอง	57
4.2.3 สมมติฐานในแบบจำลอง	58
4.3 วิธีการศึกษา	59
4.2.1 ขั้นตอนการศึกษาตามกระบวนการ ARDL	60
4.2.2 วิธีการศึกษาตามวัตถุประสงค์	61
บทที่ 5 ผลการศึกษา	63
5.1 กรณีไทยกับสหรัฐอเมริกา	65
5.2 กรณีไทยกับญี่ปุ่น	72
5.3 กรณีไทยกับเยอรมัน	79
บทที่ 6 สรุปและข้อเสนอแนะ	87
6.1 สรุปผลการศึกษา	88
6.2 ข้อเสนอแนะเชิงนโยบาย	90
6.3 ข้อเสนอแนะในการศึกษาครั้งต่อไป	91
บรรณานุกรม	92
ภาคผนวก	99
ประวัติผู้เขียน	107

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
2.1 สรุปงานศึกษาในต่างประเทศ: การวิเคราะห์ปรากฏการณ์เส้นโค้งรูปตัวเจ	21
2.2 สรุปงานศึกษาในต่างประเทศ: การวิเคราะห์เงื่อนไขของมาร์แซล - เลินเนอร์	22
2.3 สรุปงานศึกษาที่เกี่ยวข้องในประเทศไทย	23
5.1 ค่า F-statistic สำหรับวิเคราะห์การ Cointegration ระหว่างตัวแปรดุลการค้า ทั้งสองฝ่ายระหว่างประเทศไทยกับสหรัฐอเมริกา	66
5.2 การประมาณค่าสัมประสิทธิ์ของอัตราแลกเปลี่ยนและ Error - Correction Term กรณีของไทยกับสหรัฐอเมริกา	68
5.3 การประมาณค่าสัมประสิทธิ์ของตัวแปรทั้งหมดด้วยวิธีการ Error – Correction ของแบบจำลอง ARDL โดยใช้ Adjusted R ² Criterion กรณีไทยกับสหรัฐอเมริกา	70
5.4 ค่า F-statistic สำหรับวิเคราะห์การ Cointegration ระหว่างตัวแปรดุลการค้า ทั้งสองฝ่ายระหว่างประเทศไทยกับญี่ปุ่น	73
5.5 การประมาณค่าสัมประสิทธิ์ของอัตราแลกเปลี่ยนและ Error - Correction Term กรณีของไทยกับญี่ปุ่น	75
5.6 การประมาณค่าสัมประสิทธิ์ของตัวแปรทั้งหมดด้วยวิธีการ Error – Correction ของแบบจำลอง ARDL โดยใช้ Adjusted R ² Criterion กรณีไทยกับญี่ปุ่น	77
5.7 ค่า F-statistic สำหรับวิเคราะห์การ Cointegration ระหว่างตัวแปรดุลการค้า ทั้งสองฝ่ายระหว่างประเทศไทยกับเยอรมัน	80
5.8 การประมาณค่าสัมประสิทธิ์ของอัตราแลกเปลี่ยนและ Error - Correction Term กรณีไทยกับเยอรมัน	82
5.9 การประมาณค่าสัมประสิทธิ์ของตัวแปรทั้งหมดด้วยวิธีการ Error – Correction ของแบบจำลอง ARDL โดยใช้ Adjusted R ² Criterion กรณีไทยกับเยอรมัน	84

ตารางผนวก	หน้า
1 ประเทศไทยค้าสำคัญของโลก ปี 2540 - 2544	100
2 ตลาดส่งออกสำคัญของไทย ปี 2529-2546 (มกราคม)	102
3 แหล่งนำเข้าสำคัญของไทย ปี 2529-2546 (มกราคม)	103
4 สถิติการค้าระหว่างประเทศของไทย ปี 2529-2546 (มกราคม)	104
5 เครื่องซีเครียต์กิจกรรมทางการของไทย ปี 2531-2545	105



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบัญภาพ

รูป

- 3.1 ผลกระทบของการลดค่าเงินต่อคุณค่าในลักษณะเส้นโถงรูปตัวเจ 31
- 3.2 อัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงและการส่งออกสุทธิ 41

หน้า

รูปนวก

- ตัวอย่างลักษณะอัตราแลกเปลี่ยนที่เป็นตัวเงินและอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริง 106

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright[©] by Chiang Mai University
All rights reserved