

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ฎ
สารบัญภาพ	ฏ
บทที่ 1	
บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	4
1.3 ขอบเขตของการศึกษา	5
1.4 แหล่งที่มาของข้อมูล	6
1.5 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา	6
บทที่ 2	
ทฤษฎีและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	
2.1 ทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง	7
2.1.1 ทฤษฎีและแนวคิดเกี่ยวกับอัตราแลกเปลี่ยน	7
1) ทฤษฎีความเสมอภาคในอำนาจซื้อในอัตราแลกเปลี่ยน (Purchasing Power Parity of Exchange Rate)	7
2) แนวคิดการปรับตัวที่ไม่ใช่เชิงเส้นตรงไปสู่ความเสมอ ภาคในอำนาจซื้อ (Nonlinear Adjustment toward PPP)	10
2.1.2 ทฤษฎีและแนวคิดทางเศรษฐมิติ	11
1) แนวคิดการทดสอบความนิ่งของข้อมูลหรือยูนิทรูท (Unit Root Test)	13
2) การวิเคราะห์ความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพในระยะยาว (Cointegration Test)	17

	3) การประมาณค่าสมการเชิงเส้นตรงอย่างง่ายโดยวิธีกำลังสองน้อยที่สุด (Ordinary Least Squares Method : OLS)	19
	4) การตรวจสอบความผิดพลาดของสมการถดถอยเชิงเส้นตรงโดยวิธี RESET (The Regression Error Specification Test : RESET Test)	22
	5) การตรวจสอบความไม่เป็นเส้นตรงโดยวิธี BDS (Brock, Dechert and Scheinkman Test : BDS Test)	23
	6) แบบจำลองอัตสหสัมพันธ์ (Autoregressive Model) และอันดับของอัตสหสัมพันธ์ (Autoregressive Order) หรือค่า p	25
	7) แบบจำลอง Smooth Transition Autoregressive (STAR Model)	29
	8) การทดสอบความไม่เป็นเส้นตรงและการตัดสินใจเลือกกระหว่าง Logistic STAR หรือ Exponential STAR	33
	2.2 เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	36
บทที่ 3	ระเบียบวิธีวิจัย	
	3.1 วิธีการวิจัย	49
	3.1.1 การทดสอบความนิ่งของข้อมูลหรือยูนิทรูท (Unit Root Test)	49
	3.1.2 การวิเคราะห์ความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพในระยะยาว (Cointegration)	50
	3.1.3 การประมาณค่าสัมประสิทธิ์ (Coefficient) ใช้วิธีกำลังสองน้อยที่สุด (Ordinary Least Squares : OLS)	52
	3.1.4 การตรวจสอบความผิดพลาดของสมการถดถอยเชิงเส้นตรงโดยวิธี RESET (The Regression Error Specification Test : RESET Test)	53
	3.1.5 การตรวจสอบความไม่เป็นเส้นตรงโดยวิธี BDS (Brock, Dechert and Scheinkman Test : BDS Test)	55

3.1.6	การเลือก อันดับของอัตสหสัมพันธ์ (Autoregressive Order)	56
3.1.7	การทดสอบความไม่เป็นเส้นตรงด้วยสมการช่วยเชิงถดถอย (Auxiliary Regression)	57
3.1.8	การเลือกกระหว่าง Logistic STAR หรือ Exponential STAR ด้วยสมการช่วยเชิงถดถอย (Auxiliary Regression)	58
3.1.9	การประมาณค่าแบบจำลองในรูปแบบฟังก์ชัน Logistic Smooth Transition Autoregressive (LSTAR Model) หรือ ประมาณค่าแบบจำลองในรูปแบบฟังก์ชัน Exponential Smooth Transition Autoregressive (ESTAR Model)	59
3.2	แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา	61
บทที่ 4	ผลการศึกษา	
4.1	การทดสอบความนิ่งของข้อมูลหรือยูนิทรูท (Unit Root Test)	64
4.2	การวิเคราะห์ความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพในระยะยาว (Cointegration) และการประมาณค่าสัมประสิทธิ์ (Coefficient) ใช้วิธีกำลังสองน้อยที่สุด (Ordinary Least Squares : OLS)	68
4.3	การตรวจสอบความผิดพลาดของสมการถดถอยเชิงเส้นตรงโดยวิธี RESET (The Regression Error Specification Test : RESET Test)	71
4.4	การตรวจสอบความไม่เป็นเส้นตรงโดยวิธี BDS (Brock, Dechert and Scheinkman Test : BDS Test)	73
4.5	การเลือกอันดับของอัตสหสัมพันธ์ (Autoregressive Order)	76
4.6	การทดสอบความไม่เป็นเส้นตรงด้วยสมการช่วยเชิงถดถอย (Auxiliary Regression)	78
4.7	การสรุปผลการตรวจสอบความไม่เป็นเส้นตรง	80
4.8	การตัดสินใจเลือกกระหว่าง Logistic STAR หรือ Exponential STAR ด้วยสมการช่วยเชิงถดถอย (Auxiliary Regression)	83

	4.9 การประมาณค่าแบบจำลองในรูปแบบฟังก์ชัน Logistic Smooth Transition Autoregressive (LSTAR Model) หรือ ประมาณค่าแบบจำลองในรูปแบบฟังก์ชัน Exponential Smooth Transition Autoregressive (ESTAR Model)	85
บทที่ 5	สรุปผลการศึกษา	
	5.1 สรุปผลการศึกษา	95
	5.2 ข้อเสนอแนะ	97
	5.3 ข้อจำกัดและข้อเสนอแนะในการศึกษาครั้งต่อไป	98
บรรณานุกรม		99
ภาคผนวก		
	ภาคผนวก ก ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	105
	ภาคผนวก ข ตารางสถิติ	112
	ภาคผนวก ค ผลการวิเคราะห์ข้อมูล	116
ประวัติผู้เขียน		173

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
4.1	65
สรุป ผลการทดสอบยูนิทรูทของข้อมูล การเจริญเติบโตของอัตรา แลกเปลี่ยน การเจริญเติบโตของดัชนีราคาผู้บริโภค และการเจริญเติบโต ของดัชนีราคาผู้ผลิต ณ อันดับ I(0)	
4.2	69
ผลการทดสอบการร่วมไปด้วยกันและยูนิทรูทของค่าความคลาดเคลื่อน	
4.3	72
ผลการ ตรวจสอบความผิดพลาดของสมการถดถอยเชิงเส้นตรง โดยวิธี RESET	
4.4	74
ผลการ ตรวจสอบความผิดพลาดของสมการถดถอยเชิงเส้นตรง โดยวิธี BDS	
4.5	77
ผลการทดสอบ การ เลือกอันดับของอัตสหสัมพันธ์ โดย วิธี Schwarz Bayesian Information Criterion (SIC)	
4.6	78
ผลการตรวจสอบความผิดพลาดของสมการถดถอยเชิงเส้นตรง โดยสมการ ช่วยเชิงถดถอย (Auxiliary Regression)	
4.7	81
การสรุปผลการตรวจสอบความไม่เป็นเส้นตรง	
4.8	83
ผลการทดสอบการเลือกระหว่าง Logistic STAR หรือ Exponential STAR โดยสมการช่วยเชิงถดถอย (Auxiliary Regression)	
4.9	86
ผลการประมาณค่าแบบจำลองใน รูปแบบฟังก์ชัน Exponential Smooth Transition Autoregressive (ESTAR Model) กรณีการเจริญเติบโตของ อัตราแลกเปลี่ยนกับ การเจริญเติบโตของ ดัชนีราคาผู้บริโภค ระหว่าง ประเทศไทยกับสหรัฐอเมริกา	
4.10	87
ผลการ ประมาณค่า แบบจำลองใน รูปแบบฟังก์ชัน Logistic Smooth Transition Autoregressive (LSTAR Model) กรณีการเจริญเติบโตของ อัตราแลกเปลี่ยนกับ การเจริญเติบโตของ ดัชนีราคาผู้บริโภค ระหว่าง ประเทศไทยกับมาเลเซีย	

- 4.11 ผลการประมาณค่าแบบจำลองใน รูปแบบฟังก์ชัน Exponential Smooth Transition Autoregressive (ESTAR Model) กรณีการเจริญเติบโตของ อัตราแลกเปลี่ยนกับ การเจริญเติบโตของ ดัชนีราคาผู้บริโภค ระหว่าง ประเทศไทยกับสิงคโปร์ 89
- 4.12 ผลการประมาณค่าแบบจำลองใน รูปแบบฟังก์ชัน Exponential Smooth Transition Autoregressive (ESTAR Model) กรณีการเจริญเติบโตของ อัตราแลกเปลี่ยนกับ การเจริญเติบโตของ ดัชนีราคาผู้ผลิต ระหว่าง ประเทศไทยกับสหรัฐอเมริกา 90
- 4.13 ผลการ ประมาณค่า แบบจำลองใน รูปแบบฟังก์ชัน Logistic Smooth Transition Autoregressive (LSTAR Model) กรณีการเจริญเติบโตของ อัตราแลกเปลี่ยนกับ การเจริญเติบโตของ ดัชนีราคาผู้ผลิต ระหว่าง ประเทศไทยกับมาเลเซีย 92
- 4.14 ผลการ ประมาณค่า แบบจำลองใน รูปแบบฟังก์ชัน Exponential Smooth Transition Autoregressive (ESTAR Model) กรณี การเจริญเติบโตของ อัตราแลกเปลี่ยนกับ การเจริญเติบโตของ ดัชนีราคาผู้ผลิต ระหว่าง ประเทศไทยกับสิงคโปร์ 93

สารบัญภาพ

รูป	หน้า
1.1 ประเทศคู่ค้าของไทย 5 อันดับแรกวัดจากมูลค่าการค้าในปี พ.ศ. 2551-2552	3
2.1 รูปแบบของฟังก์ชัน Logistic	31
2.2 รูปแบบของฟังก์ชัน Exponential	33

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright© by Chiang Mai University
 All rights reserved