

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	น
สารบัญภาพ	ภ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัจจุบัน	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	4
1.3 ประโยชน์ของการศึกษา	4
1.4 ขอบเขตของการศึกษา	4
1.5 นิยามศัพท์	5
บทที่ 2 กรอบแนวคิดทางทฤษฎีและเอกสารที่เกี่ยวข้อง	
2.1 แนวคิดและทฤษฎีทางเศรษฐศาสตร์宏观觀	6
2.1.1 ทฤษฎีสำนักเงินเชี่ยน	6
2.1.2 ทฤษฎีวัฏจักรธุรกิจ (Real Business Cycle)	17
2.1.3 ทฤษฎีสำนักนิวนิวเคนเชี่ยน	25
2.1.4 แนวคิดแบบจำลองระบบเศรษฐกิจแบบเปิด (Small Open Economy)	27
2.2 แนวคิดและทฤษฎีทางเศรษฐมิติ	40
2.2.1 ทฤษฎีข้อมูลอนุกรมเวลา	40
2.2.2 แนวคิดการทดสอบยูนิทรูท (Unit Root test)	41
2.2.3 แนวคิดการทดสอบการร่วมกัน ไปด้วยกัน (Cointegration test)	44
2.2.4 แนวคิดการสร้างแบบจำลอง Vector autoregressive process with exogenous regressors models (VARX)	55
2.2.5 แนวคิดการทดสอบความเป็นปัจจัยนอกระบบແอง (Weakly exogeneity)	57
2.2.6 แนวคิดการวิเคราะห์การตอบสนองต่อผลกระทบ (Impulse response)	58

2.3 เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	61	
บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย		
3.1 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	65	
3.2 วิธีการวิจัย	66	
3.3 แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา	69	
บทที่ 4 ผลการศึกษา		
4.1 ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูลโดยวิธียูนิตรูท (Unit root)	73	
4.2 ผลการทดสอบการร่วมกันไปด้วยการ (Cointegration test)	83	
4.3 ผลการทดสอบความเป็นปัจจัยภายนอกแบบแอบแฝง (Weak Exogeneity)	90	
4.4 ผลการวิเคราะห์ผลกราฟจากตัวแปรทางเศรษฐศาสตร์มหภาคของประเทศไทยคู่ค้า	5 ประเทศ (Contemporaneous Effect) ต่อตัวแปรทางเศรษฐศาสตร์มหภาคภายในประเทศ	92
4.5 ผลการวิเคราะห์ผลการตอบสนองของตัวแปรทางเศรษฐศาสตร์มหภาคภายในประเทศต่อผลกราฟจากตัวแปรทางเศรษฐศาสตร์มหภาคของประเทศไทยคู่ค้าโดยประยุกต์ใช้วิธี Impulse Response Function	106	
บทที่ 5 สรุปและข้อเสนอแนะ		
5.1 บทสรุป	126	
5.2 ประโยชน์ที่ได้รับจากการศึกษา	128	
5.3 ข้อเสนอแนะ	130	
5.4 ข้อเสนอแนะในการศึกษาครั้งต่อไป	130	
เอกสารอ้างอิง	131	
ภาคผนวก ก ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	133	
ภาคผนวก ข ตารางสถิติ	147	
ภาคผนวก ค ผลการวิเคราะห์ข้อมูล	153	
ประวัติผู้เขียน	225	

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
1.1 นวัตกรรมค้าในปี พ.ศ. 2551 ของประเทศไทยค้าที่สำคัญของไทย 10 อันดับแรก	2
4.1 ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูลผลิตมวลรวม อัตราเงินเฟ้อ อัตราดอกเบี้ย ระยะสั้นรายปี อัตราแลกเปลี่ยน และราคาน้ำมันดิบเฉลี่ยทั่วโลก	75
4.2 ผลการทดสอบความขาวของความล่าหรือล้าหลัง (lag length) ของแบบจำลอง VAR	85
4.3 ผลการทดสอบรูปแบบของรูปแบบของสมการ Cointegrating Vector	86
4.4 ผลการทดสอบความสัมพันธ์ที่มีเสถียรภาพในระยะยาวและการหาจำนวน ความสัมพันธ์ในระยะยาว (Cointegrating Rank) ตามรูปแบบสมการ	89
4.5 ผลการทดสอบความเป็นปัจจัยภายนอกแบบแอบแฝง (Weakly Exogenous Variable) ของตัวแปรทางเศรษฐศาสตร์ร่วมหากความ 5 ประเทศและตัวแปรทางเศรษฐศาสตร์ มหาศาของประเทศไทย ญี่ปุ่น มาเลเซีย สิงคโปร์ และสหรัฐอเมริกา	91
4.6 การวิเคราะห์ผลกราฟจากตัวแปรเศรษฐศาสตร์ร่วมหากของประเทศไทยค้ารวม 5 ประเทศต่อตัวแปรเศรษฐศาสตร์ร่วมหากภายในประเทศ	93
4.7 การวิเคราะห์ผลกราฟจากตัวแปรเศรษฐศาสตร์ร่วมหากของประเทศไทย ต่อตัวแปรเศรษฐศาสตร์ร่วมหากภายในประเทศ	96
4.8 การวิเคราะห์ผลกราฟจากตัวแปรเศรษฐศาสตร์ร่วมหากของประเทศไทยญี่ปุ่น ต่อตัวแปรเศรษฐศาสตร์ร่วมหากภายในประเทศ	98
4.9 การวิเคราะห์ผลกราฟจากตัวแปรเศรษฐศาสตร์ร่วมหากของประเทศไทยมาเลเซีย ต่อตัวแปรเศรษฐศาสตร์ร่วมหากภายในประเทศ	100
4.10 การวิเคราะห์ผลกราฟจากตัวแปรเศรษฐศาสตร์ร่วมหากของประเทศไทยสิงคโปร์ ต่อตัวแปรเศรษฐศาสตร์ร่วมหากภายในประเทศ	102
4.11 การวิเคราะห์ผลกราฟจากตัวแปรเศรษฐศาสตร์ร่วมหากของประเทศไทยสหรัฐอเมริกา ต่อตัวแปรเศรษฐศาสตร์ร่วมหากภายในประเทศ	104
4.12 การวิเคราะห์การตอบสนองของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศต่อตัวแปรทาง เศรษฐศาสตร์ของประเทศไทย 5 ประเทศ	106
4.13 การวิเคราะห์การตอบสนองของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศต่ออัตราเงินเฟ้อ ของประเทศไทยค้า	108

4.14	การวิเคราะห์การตอบสนองของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศต่ออัตราดอกเบี้ย ระยะสั้นของประเทศไทยคู่ค้า	110
4.15	การวิเคราะห์การตอบสนองของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศต่ออัตรา ^{แลกเปลี่ยนของประเทศไทยคู่ค้าและราคาน้ำมันดิบเนลลี่ทั่วโลก}	112
4.16	การวิเคราะห์การตอบสนองของอัตราเงินเฟ้อภายในประเทศต่อผลิตภัณฑ์มวลรวม ^{ของประเทศไทยคู่ค้า}	114
4.17	การวิเคราะห์การตอบสนองของอัตราเงินเฟ้อภายในประเทศต่ออัตราเงินเฟ้อของ ^{ประเทศไทยคู่ค้า}	116
4.18	การวิเคราะห์การตอบสนองของอัตราเงินเฟ้อภายในประเทศต่ออัตราดอกเบี้ย ระยะสั้นของประเทศไทยคู่ค้า	118
4.19	การวิเคราะห์การตอบสนองของอัตราเงินเฟ้อภายในประเทศต่ออัตราแลกเปลี่ยน ^{ของประเทศไทยคู่ค้าและราคาน้ำมันดิบเนลลี่ทั่วโลก}	120
4.20	การวิเคราะห์การตอบสนองของอัตราดอกเบี้ยระยะสั้นภายในประเทศต่อ ^{ผลิตภัณฑ์มวลรวมของประเทศไทยคู่ค้า}	123
4.21	การวิเคราะห์การตอบสนองของอัตราเงินเฟ้อภายในประเทศต่ออัตราเงินเฟ้อของ ^{ประเทศไทยคู่ค้า}	124
4.22	การวิเคราะห์การตอบสนองของอัตราเงินเฟ้อภายในประเทศต่ออัตราดอกเบี้ย ระยะสั้นของประเทศไทยคู่ค้า	125

สารบัญภาพ

รูป หน้า

- 4.1 การตอบสนองของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศต่อผลิตภัณฑ์มวลรวมของประเทศไทย 107
- 4.2 การตอบสนองของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศต่ออัตราเงินเพื่อของประเทศไทย 109
- 4.3 การตอบสนองของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศต่ออัตราดอกเบี้ยระยะสั้นของประเทศสิงคโปร์ 111
- 4.4 การตอบสนองของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศต่ออัตราแลกเปลี่ยนของประเทศสหรัฐอเมริกา 113
- 4.5 การตอบสนองของอัตราเงินเพื่อภายในประเทศต่อผลิตภัณฑ์มวลรวมของประเทศญี่ปุ่น 115
- 4.6 การตอบสนองของอัตราเงินเพื่อภายในประเทศต่ออัตราเงินเพื่อของประเทศมาเลเซีย 117
- 4.7 การตอบสนองของอัตราเงินเพื่อภายในประเทศต่ออัตราดอกเบี้ยระยะสั้นของประเทศญี่ปุ่น 119
- 4.8 การตอบสนองของอัตราเงินเพื่อภายในประเทศต่ออัตราแลกเปลี่ยนของประเทศมาเลเซีย 121