

ชื่อเรื่องวิทยานิพนธ์

ปัจจัยที่มีผลต่อราคาทองคำแท่งในประเทศไทย
ก่อนและหลังวิกฤตเศรษฐกิจของประเทศสหรัฐอเมริกา

ผู้เขียน

นางสาวอัศพรภักดิ์ ประภาพักตร์

ปริญญา

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์

ผศ.ดร.ไพรัช กาญจนการุณ อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก
อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์กุล อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

บทคัดย่อ

การศึกษานี้มีวัตถุประสงค์เพื่อศึกษาปัจจัยที่มีผลต่อราคาทองคำแท่งในประเทศไทย ก่อนและหลังวิกฤตเศรษฐกิจของประเทศสหรัฐอเมริกา โดยใช้ข้อมูลอนุกรมเวลาแบบรายเดือนตั้งแต่เดือนมกราคม พ.ศ. 2545 ถึงเดือนธันวาคม พ.ศ. 2553 จำนวน 108 ข้อมูลและใช้วิธีการวิเคราะห์อาร์แม็กซ์ (ARIMAX) ผลการศึกษาพบว่า ปัจจัยที่มีผลต่อการเปลี่ยนแปลงราคาทองคำแท่งในประเทศไทยที่ระดับนัยสำคัญทางสถิติ ได้แก่ การเปลี่ยนแปลงดัชนีอุตสาหกรรมในประเทศไทย การเปลี่ยนแปลงราคาทองคำแท่งในตลาดโลกล่วงหน้า และการเปลี่ยนแปลงอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อดอลลาร์สหรัฐฯ โดยมีความสัมพันธ์ในทิศทางเดียวกัน สำหรับตัวแปรหุ่นที่แสดงการเกิดวิกฤตเศรษฐกิจของประเทศสหรัฐอเมริกา และการเปลี่ยนแปลงราคาทองคำแท่ง ใน 2 ช่วงเวลาที่ผ่านมา AR(2) มีความสัมพันธ์ในทิศทางตรงกันข้าม ที่ระดับนัยสำคัญทางสถิติ 0.05

Thesis Title Factors Affecting the Gold Bullion Price in Thailand
Before and After the Economic Crisis of the U.S.A.

Author Miss Aksaraphak Praphaphak

Degree Master of Economics

Thesis Advisory Committee

Asst. Prof. Dr. Pairat Kanjanakaroon Advisor

Lect. Dr. Chaiwat Nimanussornkul Co-advisor

ABSTRACT

The aim of this study was to find out factors affecting the gold bullion price in Thailand before and after the Economic Crisis of the U.S. Monthly data were collected during January 2002 to December 2010, totally 108 observations using ARIMAX method. The result indicated that the changes of industrial index, gold future price and exchange rate had significantly positive effect on gold bullion price in Thailand. However, a dummy variable represented the U.S. economic crisis and autoregressive in the two past period, AR(2) were found to be negative with the significance at 0.05 level.