

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ก
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ญ
สารบัญภาพ	ฎ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 หลักการและเหตุผล	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	4
1.3 ประโยชน์ที่ได้รับการศึกษา	4
1.4 ขอบเขตของการศึกษา	5
บทที่ 2 ทฤษฎีแนวคิด และวรรณกรรมปริทัศน์	
2.1 ทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง	7
2.2 วรรณกรรมที่เกี่ยวข้อง	19
บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย	
3.1 วิธีการวิจัย	24
3.2 การทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาว	24
3.2.1 การทดสอบความนิ่ง (Unit Root Test)	24
3.2.2 การทดสอบความสอดคล้องของข้อมูลอนุกรมเวลา (Cointegration test)	25
3.2.3 การทดสอบ Error Correction Mechanism (ECM)	26
3.2.4 การทดสอบสมมติฐานเชิงเป็นเหตุเป็นผล (Causality Test)	28
บทที่ 4 ผลการศึกษา	
4.1 ผลการวิเคราะห์การทดสอบความนิ่ง (Unit Root)	30
4.2 ผลการวิเคราะห์การทดสอบการร่วมกันไปด้วยกัน (Cointegration)	32

4.3 ผลการทดสอบลักษณะการปรับตัวระยะสั้น ตามแบบจำลอง Error Correction Model : ECM	36
4.4 การทดสอบสมมติฐานเชิงเหตุเป็นผล (Causality Test)	39
บทที่ 5 สรุปและข้อเสนอแนะ	
5.1 สรุปผลการศึกษา	40
5.2 ข้อเสนอแนะ	42
เอกสารอ้างอิง	43
ภาคผนวก	
ภาคผนวก ก ตารางผลการทดสอบความนิ่ง Unit Root Test	46
ภาคผนวก ข ผลการทดสอบ Cointegration	51
ภาคผนวก ค ผลการทดสอบส่วนที่เหลือ (Residual) จากสมการถดถอย Cointegration โดยการทดสอบยูนิทรูท (Unit Root) ด้วยวิธี ADF Statistic Test	53
ภาคผนวก ง ผลการทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพในระยะสั้น	56
ภาคผนวก จ ผลการทดสอบ Granger Causality Test	58
ภาคผนวก ฉ ข้อมูลดัชนีราคาผู้บริโภคในประเทศไทย (Consumer Prices Index : CPI) และราคาน้ำมันดิบ	60
ประวัติผู้เขียน	64

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
1.1 อัตราเงินเฟ้อ	1
1.2 การนำเข้าพลังงาน	5
1.3 ราคาน้ำมันดิบในตลาดโลก	5
4.1 ผลการทดสอบความนิ่ง (Unit Root Test) ของข้อมูลดัชนีราคาผู้บริโภคและ ราคาน้ำมันดิบดูไบ โดยใช้วิธี ADF Test Statistic	31
4.2 ตารางผลการประมาณค่าสมการโดยวิธีกำลังสองน้อยที่สุดของดัชนีราคาผู้บริโภค และราคาน้ำมันดิบดูไบ ในกรณีที่ราคาน้ำมันดิบเป็นตัวแปรตามและดัชนีราคาผู้บริโภค เป็นตัวแปรอิสระ	33
4.3 ผลการทดสอบความนิ่ง (Unit Root) ของส่วนที่เหลือ จากสมการถดถอยด้วย วิธี Augmented Dicky Fuller กรณี $OP = f(CPI)$	34
4.4 ตารางผลการประมาณค่าสมการโดยวิธีกำลังสองน้อยที่สุดของดัชนีราคาผู้บริโภค และราคาน้ำมันดิบ ในกรณีที่ราคาน้ำมันดิบเป็นตัวแปรอิสระและดัชนีราคาผู้บริโภค เป็นตัวแปรตาม	35
4.5 ผลการทดสอบความนิ่ง (Unit Root) ของส่วนที่เหลือ จากสมการถดถอยด้วย วิธี Augmented Dicky Fuller กรณี $CPI = f(OP)$	35
4.6 ผลการประมาณค่าสัมประสิทธิ์โดยแบบจำลอง Error Correction Model :ECM โดยให้ราคาน้ำมันดิบดูไบเป็นตัวแปรตาม และดัชนีราคาผู้บริโภคในประเทศไทย เป็นตัวแปรอิสระ	37
4.7 ผลการประมาณค่าสัมประสิทธิ์โดยแบบจำลอง Error Correction Model :ECM โดยให้ดัชนีราคาผู้บริโภคในประเทศไทยเป็นตัวแปรตาม และราคาน้ำมันดิบดูไบ เป็นตัวแปรอิสระ	38
4.8 ผลการทดสอบ Granger Causality	39

สารบัญภาพ

รูป	หน้า
1.1 ดัชนีราคาผู้บริโภค	2
1.2 ราคาน้ำมันดิบดูไบ	3
1.3 แสดงความสัมพันธ์ระหว่างราคาน้ำมันดิบและอัตราเงินเฟ้อ	4
2.1 ภาวะเงินเฟ้อแบบมีอุปสงค์ส่วนเกิน	8
2.2 ภาวะเงินเฟ้อจากการใช้จ่าย	10
2.3 ภาวะเงินเฟ้อที่เกิดจากต้นทุนการผลิต	11