

สารบัญ

หน้า

กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	จ
สารบัญตาราง	ช
สารบัญภาพ	ฉ
<b>บทที่ 1 บทนำ</b>	
1.1 หลักการและเหตุผล	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	2
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา	2
1.4 ขอบเขตของการศึกษา	3
1.5 นิยามศัพท์	3
<b>บทที่ 2 ทฤษฎีและผลงานการศึกษาที่เกี่ยวข้อง</b>	
2.1 ทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง	4
2.1.1 ทฤษฎีปริมาณเงินอย่างหยาบ	4
2.1.2 ทฤษฎีปริมาณเงินของเออร์วิง ฟิชเชอร์	5
2.1.3 ทฤษฎีปริมาณเงินของเคมบริดจ์	7
2.1.4 แบบจำลองความพึงพอใจในสภาพคล่อง	9
2.1.5 แบบจำลองพลวัตของเงิน	13
2.1.6 ทฤษฎีการกำหนดปริมาณเงิน	19
2.1.7 ทฤษฎีบทข้อมูลอนุกรมเวลา	24
2.2 เอกสาร และงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	33

บทที่ 3	ระเบียบและวิธีการศึกษา	
	3.1 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root Test)	36
	3.2 การทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาว (Cointegration)	37
	3.3 การทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะสั้น (Error Correction Model )	39
	3.4 การทดสอบสมมุติฐานความเป็นเหตุเป็นผล (Granger Causality)	40
บทที่ 4	ผลการศึกษา	
	4.1 ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล	43
	4.2 ผลการทดสอบการร่วมกันไปด้วยกัน	47
	4.3 ผลการทดสอบกลไกการปรับตัวเข้าสู่ดุลยภาพในระยะสั้น	50
	4.4 ผลการทดสอบต้นเหตุ	53
บทที่ 5	สรุปและข้อเสนอแนะ	
	5.1 สรุปผลการศึกษา	56
	5.2 ข้อเสนอแนะ	57
	เอกสารอ้างอิง	58
	ภาคผนวก	
	ภาคผนวก ก	61
	ภาคผนวก ข	66
	ประวัติผู้เขียน	82

## สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
4.1 แสดงผลการทดสอบ unit root ของปริมาณเงินในความหมายกว้างที่สุดหรือ M3 ณ ระดับ I(0)	43
4.2 แสดงผลการทดสอบ unit root ของปริมาณเงินในความหมายกว้างที่สุดหรือ M3 ณ ระดับ I(1)	44
4.3 แสดงผลการทดสอบ unit root ของดัชนีราคาผู้บริโภค ณ ระดับ I(0)	45
4.4 แสดงผลการทดสอบ unit root ของดัชนีราคาผู้บริโภค ณ ระดับ I(1)	46
4.5 แสดงผลการทดสอบ Cointegration และ unit root ของค่าความคลาดเคลื่อน	47
4.6 แสดงผลการทดสอบ Error Correction Mechanism	50
4.7 แสดงผลการทดสอบ serial correlation LM test และ white heteroskedasticity test	51
4.8 แสดงการเลือกช่วงเวลาที่เหมาะสมของการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล	54
4.9 แสดงผลการทดสอบ Granger Causality	55

สารบัญภาพ

รูป	หน้า
2.1 แสดงจุดดุลยภาพของอุปสงค์ของเงินและอุปทานของเงินกับอัตราดอกเบี้ย	9
2.2 แสดงผลกระทบจากการเพิ่มอุปทานของเงินต่ออุปสงค์ของเงิน	11
2.3 แสดงผลกระทบจากรายได้ที่เพิ่มขึ้น	12
2.4 แสดงผลกระทบพลวัตจากการเพิ่มอุปทานของเงินต่ออัตราดอกเบี้ย	15
2.5 แสดงผลกระทบพลวัตจากการเพิ่มอัตราดอกเบี้ยต่ออุปทานของเงินต่ออัตราดอกเบี้ย	17
2.6 แสดงผลกระทบพลวัตจากการเพิ่มอัตราดอกเบี้ยต่ออุปทานของเงินเมื่อมี การคาดการณ์ที่ดี	18
4.1 แสดงการเคลื่อนไหวของข้อมูล M และ CPI รายเดือนตั้งแต่ปี พ.ศ. 2541-2549	42