

สารบัญ

| | หน้า |
|---|------|
| กิตติกรรมประกาศ | ค |
| บทคัดย่อภาษาไทย | ง |
| บทคัดย่อภาษาอังกฤษ | ฉ |
| สารบัญตาราง | ญ |
| บทที่ 1 บทนำ | |
| 1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา | 1 |
| 1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา | 6 |
| 1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ | 6 |
| 1.4 ขอบเขตการศึกษา | 6 |
| บทที่ 2 แนวคิด ทฤษฎีและผลงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง | |
| 2.1 แนวคิดและทฤษฎีทางเศรษฐศาสตร์ | 7 |
| 2.2 แนวคิดและวิธีการทางเศรษฐมิติ | |
| 2.2.1 การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของข้อมูลอนุกรมเวลาและการทดสอบ ยูนิทรูท | 9 |
| 2.2.2 แนวคิดเกี่ยวกับการร่วมกันไปด้วยกัน | 11 |
| 2.2.3 แนวคิดเกี่ยวกับความสัมพันธ์เชิงคุณภาพในระยะสั้น | 13 |
| 2.2.4 แนวคิดเกี่ยวกับการทดสอบสมมติฐานเชิงเป็นเหตุเป็นผล | 14 |
| 2.3 เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง | 16 |

| | |
|--|----|
| บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย | |
| 3.1 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา | 23 |
| 3.2 แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา | 23 |
| บทที่ 4 ผลการศึกษา | |
| 4.1 ผลการทดสอบความนึ่งของข้อมูลหรือยูนิทรุต | 26 |
| 4.2 การวิเคราะห์ความสัมพันธ์เชิงคุณภาพในระยะยาว | |
| 4.2.1 ตัวแปรทางเศรษฐศาสตร์เป็นตัวแปรอิสระและราคาทองคำภายใน ประเทศไทยเป็นตัวแปรตาม | 36 |
| 4.3 ผลการวิเคราะห์ความสัมพันธ์เชิงคุณภาพในระยะสั้น | |
| 4.3.1 ตัวแปรทางเศรษฐศาสตร์เป็นตัวแปรอิสระและราคาทองคำภายใน ประเทศไทยเป็นตัวแปรตาม | 41 |
| 4.4 ผลการทดสอบสมมติฐานเชิงเป็นเหตุเป็นผล | 46 |
| บทที่ 5 สรุปผลการศึกษา | |
| 5.1 สรุปผลการศึกษา | 51 |
| 5.2 ข้อเสนอแนะ | 53 |
| เอกสารอ้างอิง | 54 |
| ภาคผนวก | |
| ภาคผนวก ก ข้อมูลราคาทองคำและปัจจัยทางเศรษฐศาสตร์มหภาคที่นำมาศึกษา | 58 |
| ภาคผนวก ข ตารางค่าสถิติ Durbin-Watson ค่าของ d_L และ d_U | 65 |
| ภาคผนวก ค ตารางผลการคำนวณจากโปรแกรม Eviews 5.1 | 67 |
| ประวัติผู้เขียน | 84 |

สารบัญตาราง

| ตาราง | หน้า |
|---|------|
| 4.1 ผลการทดสอบยูนิทรูท ของข้อมูลราคาทองคำภายในประเทศ | 27 |
| 4.2 ผลการทดสอบยูนิทรูท ของดัชนีราคาผู้บริโภคเปรียบเทียบระหว่างไทยกับสหรัฐฯ | 29 |
| 4.3 ผลการทดสอบยูนิทรูท ของอัตราแลกเปลี่ยนสกุลเงินบาทต่อดอลลาร์สหรัฐฯ | 31 |
| 4.4 ผลการทดสอบยูนิทรูท ของอัตราดอกเบี้ยนโยบายเปรียบเทียบระหว่างไทยกับสหรัฐฯ | 33 |
| 4.5 ผลการทดสอบยูนิทรูท ของราคาน้ำมันดิบในตลาด NYMEX | 35 |
| 4.6 ผลการทดสอบ Cointegration และ Unit Root ของค่าตลาดเคลื่อน | 37 |
| 4.7 ผลการวิเคราะห์ความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพในระยะสั้นตามแบบจำลอง ECM | 41 |
| 4.8 เลือกช่วงเวลาที่เหมาะสมสำหรับการทดสอบเป็นเหตุเป็นผล | 47 |
| 4.9 ผลการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล (Granger Causality) | 48 |