

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ญ
สารบัญภาพ	ฎ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	4
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับการศึกษา	4
1.4 ขอบเขตการศึกษา	4
1.5 นิยามคำศัพท์	5
บทที่ 2 ทฤษฎีและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	
2.1 ทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง	
2.1.1 รายได้ประชาชาติดุลยภาพแนวส่วนร่วมไหลเท่ากับส่วนอัดฉีด	6
2.1.2 แนวคิดการบริโภคข้ามช่วงเวลาประยุกต์กับดุลบัญชีเดินสะพัด	7
2.1.3 รายจ่ายรัฐบาล	15
2.1.4 ดุลบัญชีเดินสะพัด	18
2.1.5 ทฤษฎีการวิเคราะห์ทางเศรษฐมิติ	
1) การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root Test)	20
2) แบบจำลอง Vector Autoregression (VAR)	23
2.2 เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	37

บทที่ 3	ระเบียบวิธีวิจัย	
3.1	ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	40
3.2	แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา	40
3.3	วิธีวิจัย	
3.3.1	การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root Test)	43
3.3.2	การเลือกความล่าช้า (Lag) ที่เหมาะสม	43
3.3.3	แบบจำลอง Vector Autoregression (VAR)	44
3.3.4	การวิเคราะห์ปฏิกิริยาตอบสนองต่อความแปรปรวน (Impulse Response Function)	45
3.3.5	การวิเคราะห์การแยกส่วนของความแปรปรวน (Variance Decomposition)	45
บทที่ 4	ผลการศึกษา	
4.1	ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root Test)	46
4.2	ผลการทดสอบและการเลือกความล่าช้า (Lag)	48
4.3	การประมาณค่าแบบจำลอง VAR และการทดสอบ Stability	49
4.4	ผลการวิเคราะห์ปฏิกิริยาตอบสนองต่อความแปรปรวน (Impulse Response Function)	56
4.5	ผลการวิเคราะห์การแยกส่วนของความแปรปรวน (Variance Decomposition)	62
บทที่ 5	บทสรุปและข้อเสนอแนะ	
5.1	สรุปผลการศึกษา	67
5.2	ข้อเสนอแนะ	70
	เอกสารอ้างอิง	71
	ภาคผนวก	
	ภาคผนวก ก ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	75
	ภาคผนวก ข ผลการประมาณค่าจากโปรแกรม	79
	ประวัติผู้เขียน	94

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
1.1 ตุลาคมชำระหนี้ของประเทศไทย ปี พ.ศ. 2548 ถึง พ.ศ. 2553	2
4.1 ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูลการใช้จ่ายภาครัฐบาล (รายจ่ายประจำ และรายจ่ายเพื่อการลงทุน) การลงทุนภาคเอกชน และดุลบัญชีเดินสะพัด	47
4.2 การเลือกความล่าช้าของการศึกษา	48
4.3 ผลการประมาณค่าแบบจำลอง VAR	49
4.4 ผลการทดสอบ VAR Stability Condition check Roots of Characteristic Polynomial	55
4.5 ผลการวิเคราะห์การแยกส่วนของความแปรปรวนของดุลบัญชีเดินสะพัด	62
4.6 ผลการวิเคราะห์การแยกส่วนของความแปรปรวนของ การเปลี่ยนแปลงการใช้จ่ายของรัฐบาลประเภทรายจ่ายประจำ	64
4.7 ผลการวิเคราะห์การแยกส่วนของความแปรปรวนของ การเปลี่ยนแปลงการใช้จ่ายของรัฐบาลประเภทรายจ่ายประจำ	65
4.8 ผลการวิเคราะห์การแยกส่วนของความแปรปรวนของการเปลี่ยนแปลงการลงทุนภาคเอกชน	66

สารบัญภาพ

รูป	หน้า
2.1 การบริโภคข้ามเวลา (Consumption Over Time) และดุลบัญชีเดินสะพัด	8
4.1 ผลการทดสอบ VAR Stability แสดงโดยรูปวงกลมรัศมีหนึ่งหน่วย	55
4.2 ผลการวิเคราะห์ปฏิกิริยาตอบสนองของดุลบัญชีเดินสะพัดต่อความแปรปรวน	57
4.3 ผลการวิเคราะห์ปฏิกิริยาตอบสนองของการเปลี่ยนแปลงของ การใช้จ่ายของรัฐบาลประเภทรายจ่ายประจำต่อความแปรปรวน	58
4.4 ผลการวิเคราะห์ปฏิกิริยาตอบสนองของการเปลี่ยนแปลงของ การใช้จ่ายของรัฐบาลประเภทรายจ่ายเพื่อการลงทุนต่อความแปรปรวน	60
4.5 ผลการวิเคราะห์ปฏิกิริยาตอบสนองของการเปลี่ยนแปลงของ การลงทุนภาคเอกชนต่อความแปรปรวน	61