

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ก
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ฉ
สารบัญภาพ	ฉ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	9
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา	9
1.4 นิยามศัพท์	10
1.5 ขอบเขตของการศึกษา	10
บทที่ 2 แนวคิด ทฤษฎีและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	
2.1 กรอบแนวคิดทางทฤษฎี	11
2.1.1 แนวความคิดทางทฤษฎีเกี่ยวกับการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยนที่มีผลต่อปริมาณการค้าระหว่างประเทศ	11
2.1.2 ทฤษฎีที่ใช้อธิบายการเปลี่ยนแปลงในอัตราแลกเปลี่ยน	12
2.1.3 การกำหนดอัตราแลกเปลี่ยน	15
2.1.4 แนวคิดทางความยืดหยุ่น (Elasticities Approach)	18
2.2 ทฤษฎีการวิเคราะห์ทางเศรษฐมิติ	23
2.2.1 การวิเคราะห์อนุกรมเวลา	23
2.2.2 การทดสอบยูนิตรุต (Unit Root Test)	23
2.2.3 การทดสอบ Cointegration	26
2.2.4 การทดสอบ Error Correction Model (ECM)	28

2.3	เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	29
บทที่ 3	ระเบียบวิธีการศึกษา	
3.1	ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	35
3.2	แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา	35
3.2.1	สมมติฐานในการศึกษา	36
3.2.2	การคำนวณอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงในแบบจำลอง	37
3.3	วิธีการศึกษา	38
บทที่ 4	ผลการศึกษา	
4.1	ผลการศึกษาคำนวณอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงในแบบจำลอง	41
4.2	การศึกษาความสัมพันธ์ระยะยาว กรณีผลกระทบต่อปริมาณการส่งออก สินค้าเข้าไปยังประเทศสหรัฐอเมริกา	43
4.2.1	ผลการทดสอบ Unit root	43
4.2.2	ผลการทดสอบ Cointegration	45
4.2.3	ผลการทดสอบ Error Correction Model (ECM)	47
4.3	การศึกษาความสัมพันธ์ระยะยาว กรณีผลกระทบต่อปริมาณการส่งออก สินค้าเข้าไปยังประเทศจีน	48
4.3.1	ผลการทดสอบ Unit root	48
4.3.2	ผลการทดสอบ Cointegration	50
4.3.3	ผลการทดสอบ Error Correction Model (ECM)	52
บทที่ 5	บทสรุปและข้อเสนอแนะ	
5.1	สรุปผลการศึกษา	55
5.1.1	สรุปผลการทดสอบ Unit root	55
5.1.2	สรุปผลการทดสอบความสัมพันธ์ระยะยาว (Cointegration)	56
5.1.3	สรุปผลการทดสอบ Error Correction Model (ECM)	57
5.2	ข้อเสนอแนะเชิงนโยบาย	57
5.3	ข้อเสนอแนะเพื่อการศึกษาครั้งต่อไป	58

เอกสารอ้างอิง

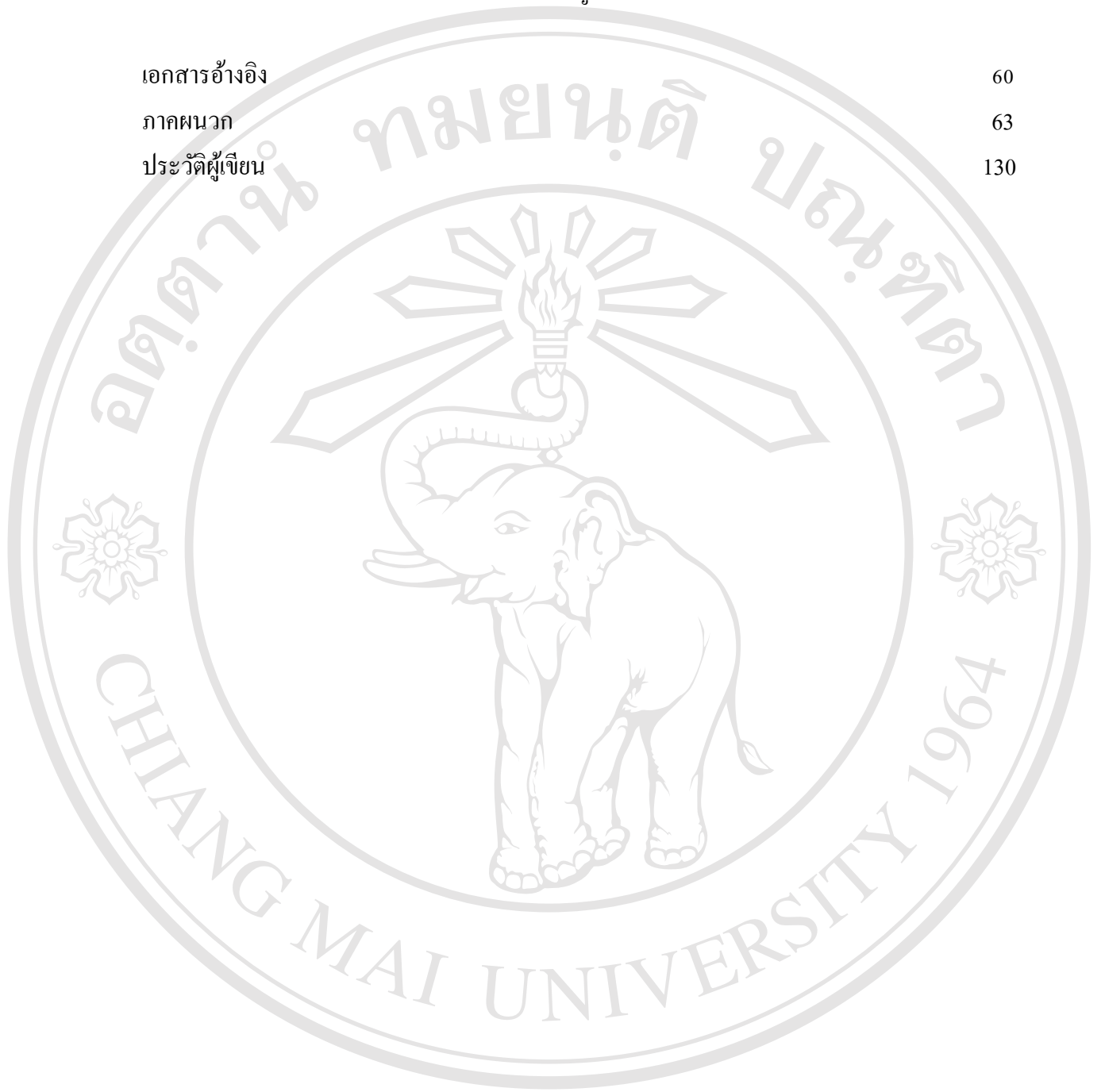
60

ภาคผนวก

63

ประวัติผู้เขียน

130



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
1.1 มูลค่าและอัตราการขยายตัวของสินค้าส่งออก สินค้านำเข้า และดุลการค้าของประเทศไทยตั้งแต่ปี 2545 – 2554	3
1.2 มูลค่าและสัดส่วนการส่งออกสินค้าของไทยตั้งแต่ปี 2544 – 2555	4
1.3 มูลค่าและอันดับการส่งออกสินค้าเกษตรที่สำคัญ 5 ชนิดของไทยตั้งแต่ปี 2550 – 2554	5
1.4 มูลค่าการส่งออกสินค้าข้าวของไทยไปยังประเทศคู่ค้าที่สำคัญตั้งแต่ปี 2550 – 2554	6
4.1 ผลการทดสอบ Unit root ตามวิธี Augmented Dickey - Fuller Test : ADF Test ของตัวแปรระดับ (Level) กรณีผลกระทบต่อปริมาณการส่งออกสินค้าข้าวไปยังประเทศสหรัฐอเมริกา	43
4.2 ผลการทดสอบ Unit root ตามวิธี Augmented Dickey - Fuller Test : ADF Test ของตัวแปรในรูปผลต่างลำดับที่หนึ่ง (First Difference) กรณีผลกระทบต่อปริมาณการส่งออกสินค้าข้าวไปยังประเทศสหรัฐอเมริกา	44
4.3 ผลการทดสอบ Unit root ของค่า $\hat{\varepsilon}_t$ จากสมการถดถอย (regression equation) กรณีผลกระทบต่อปริมาณการส่งออกสินค้าข้าวไปยังประเทศสหรัฐอเมริกา	46
4.4 ผลการประมาณ Error Correction Model กรณีผลกระทบต่อปริมาณการส่งออกสินค้าข้าวไปยังประเทศสหรัฐอเมริกา	47
4.5 ผลการทดสอบ Unit root ตามวิธี Augmented Dickey - Fuller Test : ADF Test ของตัวแปรระดับ (Level) กรณีผลกระทบต่อปริมาณการส่งออกสินค้าข้าวไปยังประเทศจีน	48
4.6 ผลการทดสอบ Unit root ตามวิธี Augmented Dickey - Fuller Test : ADF Test ของตัวแปรในรูปผลต่างลำดับที่หนึ่ง (First Difference) กรณีผลกระทบต่อปริมาณการส่งออกสินค้าข้าวไปยังประเทศจีน	49
4.7 ผลการทดสอบ Unit root ของค่า $\hat{\varepsilon}_t$ จากสมการถดถอย (regression equation) กรณีผลกระทบต่อปริมาณการส่งออกสินค้าข้าวไปยังประเทศจีน	52
4.8 ผลการประมาณ Error Correction Model กรณีผลกระทบต่อปริมาณการส่งออกสินค้าข้าวไปยังประเทศจีน	52

สารบัญภาพ

รูป	หน้า
1.1 อัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อดอลลาร์สหรัฐฯ ตั้งแต่ปี 2539-2555	7
1.2 ปริมาณการส่งออกข้าวของประเทศไทยไปยังประเทศสหรัฐอเมริกาตั้งแต่ปี 2545 – 2554	7
1.3 อัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อหยวนตั้งแต่ปี 2539-2555	8
1.4 ปริมาณการส่งออกข้าวของประเทศไทยไปยังประเทศจีน ตั้งแต่ปี 2545-2554	8
2.1 ผลกระทบของอัตราแลกเปลี่ยนที่มีผลต่อปริมาณการค้าระหว่างประเทศ	12
2.2 อุปสงค์เงินตราต่างประเทศ	16
2.3 อุปทานเงินตราต่างประเทศ	17
2.4 อัตราแลกเปลี่ยนดุลยภาพ	17
2.5 ดุลยภาพของตลาดสินค้าในตลาดโลก	18
2.6 ความสัมพันธ์ระหว่างปริมาณเงินดอลลาร์สหรัฐฯ และอัตราแลกเปลี่ยน	18
2.7 ดุลยภาพของตลาดสินค้าในตลาดโลก	20
2.8 ความสัมพันธ์ระหว่างปริมาณเงินดอลลาร์สหรัฐฯ และอัตราแลกเปลี่ยน	20
2.9 ดุลยภาพของตลาดเงินตราต่างประเทศ	21
4.1 อัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงของประเทศไทยต่อหน่วยเงินของประเทศสหรัฐอเมริกา ในช่วงเวลาที่ผ่านมาใช้ในการศึกษา ตั้งแต่ปี 2535 - 2554	42
4.2 อัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงของประเทศไทยต่อหน่วยเงินของประเทศจีนในช่วงเวลา ที่ผ่านมาใช้ในการศึกษา ตั้งแต่ปี 2535 – 2554	42