

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	จ
สารบัญตาราง	ช
สารบัญภาพ	ฅ
สารบัญตารางภาคผนวก	ญ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	9
1.3 ประโยชน์ที่ได้รับจากการศึกษา	9
1.4 ขอบเขตของการศึกษา	9
1.5 นิยามศัพท์เฉพาะ	10
1.6 กรอบแนวคิดในการวิจัย	12
1.7 สมมติฐานในการวิจัย	12
บทที่ 2 กรอบแนวคิดทางทฤษฎี เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	
2.1 เอกสารที่เกี่ยวข้อง	13
2.2 แนวคิดและทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง	
1) การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root Test)	16
2) ทฤษฎีแบบจำลอง ARIMAX	17
3) ตัวแปรหุ่น (Dummy Variable)	19
2.3 งานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	20

บทที่ 3 ระเบียบวิธีการวิจัย	
3.1 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	28
3.2 วิธีการเก็บรวบรวมข้อมูล	28
3.3 การสร้างเครื่องมือที่ใช้ในการวิจัย	29
3.4 การวิเคราะห์ข้อมูล	29
3.5 แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา	30
บทที่ 4 ผลการศึกษา	
4.1 ผลการวิเคราะห์ความนิ่ง (Unit Root) ของตัวแปรที่นำมาศึกษา โดยวิธี Augmented Dickey-Fuller test (ADF)	35
4.2 ผลการวิเคราะห์แบบถดถอยพหุคูณเชิงซ้อน (Multiple Regression Analysis) ARIMAX	39
4.3 ผลการศึกษานโยบายทางเศรษฐกิจที่มีผลต่อราคาทองคำแห่งประเทศไทย ก่อนและหลังวิกฤตเศรษฐกิจของประเทศสหรัฐอเมริกา	42
4.4 ผลการวิเคราะห์ตัวแปรหุ่น (Dummy Variable)	43
บทที่ 5 สรุปผลการศึกษา อภิปรายผล และข้อเสนอแนะ	
5.1 สรุปผลการศึกษา	45
5.2 อภิปรายผลการศึกษา	48
5.3 ข้อเสนอแนะ	48
เอกสารอ้างอิง	49
ภาคผนวก	
ภาคผนวก ก ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล ด้วยโปรแกรม Eviews 7.0	50
ภาคผนวก ข ผลการประเมินแบบจำลอง ARIMAX ด้วยโปรแกรม Eviews 7.0	77
ประวัติผู้เขียน	79

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
4.1 ผลการทดสอบ Unit Root โดยวิธี Augmented Dickey-Fuller (ADF)	36
4.2 ผลการทดสอบ Unit Root โดยวิธี Augmented Dickey-Fuller (ADF) หลังการแก้ไขข้อมูลที่ nonstationary ให้เป็น stationary โดย 1 st Different	38
4.3 ผลค่าพารามิเตอร์และค่า t-Statistics	40

สารบัญภาพ

รูป		หน้า
1.1	ราคาทองคำเฉลี่ย ปี 2002-2012	1
1.2	ราคาทองคำเฉลี่ยย้อนหลัง 1 ปี ตั้งแต่เดือนเมษายน 2011 ถึงเดือนมีนาคม 2012	2
1.3	ราคาน้ำมันดิบในตลาดโลกเฉลี่ย ปี 2545-2553	3
1.4	อัตราดอกเบี้ยเงินกู้ยืมระหว่างธนาคารเฉลี่ย ปี 2545-2553	4
1.5	ราคาทองคำแท่งในตลาดโลกกับ GDP ประเทศสหรัฐอเมริกา ปี 1999-2010	5
1.6	ดัชนีอุตสาหกรรมในประเทศไทยเฉลี่ย ปี 2545-2553	6
1.7	อัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์สหรัฐอเมริกาเฉลี่ย ปี 2545-2553	7
1.8	กรอบแนวคิดในการวิจัย	12
4.1	ราคาทองคำแท่งในประเทศไทย ก่อนและหลังการเกิดวิกฤตเศรษฐกิจของ ประเทศสหรัฐอเมริกา	43

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบัญตารางภาคผนวก

ตารางภาคผนวก		หน้า
1 ก	ผลการทดสอบความนิ่งของดัชนีราคาผู้บริโภคในประเทศไทย	50
2 ก	ผลการทดสอบความนิ่งของราคาน้ำมันในตลาดโลก	53
3 ก	ผลการทดสอบความนิ่งของราคาทองคำแท่ง ณ ตลาดกรุงเทพ	56
4 ก	ผลการทดสอบความนิ่งของราคาทองคำแท่งในตลาดโลกล่วงหน้า	58
5 ก	ผลการทดสอบความนิ่งของเงินกู้ระหว่างธนาคาร	62
6 ก	ผลการทดสอบความนิ่งของอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อดอลลาร์สหรัฐฯ	65
7 ก	ผลการทดสอบความนิ่งของดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย	68
8 ก	ผลการทดสอบความนิ่งของดัชนีอุตสาหกรรมในประเทศไทย	71
9 ข	ผลการทดสอบจากแบบจำลอง ARIMAX	74
10 ข	ผลการทดสอบ Autocorrelation	75
11 ข	ผลการวิเคราะห์ตัวแปรหุ่น (Dummy Variable)	75