

สารบัญ

หน้า

สารบัญตาราง	(3)
สารบัญภาพ	(7)
บทที่ 1 บทนำ	1
ความสำคัญของปัญหา	1
วัตถุประสงค์ของการศึกษา	4
ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ	4
ขอบเขตการศึกษา	5
วิธีการศึกษา	5
การเก็บรวบรวมข้อมูล	5
การวิเคราะห์ข้อมูล	5
บทที่ 2 โครงร่างทางทฤษฎี	7
การตรวจเอกสาร	7
แนวคิดและทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง	13
แบบจำลองที่ใช้ในการวิจัย	24
สมมติฐานในการวิจัย	33
บทที่ 3 สภาพทั่วไปของเงินเฟ้อและนโยบายการเงินของประเทศไทยในปัจจุบัน	35
สภาพทั่วไปของภาวะเงินเฟ้อ	35
สาเหตุของเงินเฟ้อในประเทศไทย ตั้งแต่ปี พ.ศ. 2536 - พ.ศ. 2548	35
นโยบายการเงินของประเทศไทยในปัจจุบัน	45
บทที่ 4 ผลการศึกษา	49
ผลการทดสอบคุณสมบัติความนึ่งของข้อมูล	49

สารบัญ (ต่อ)

	หน้า
ผลการคาดประมาณค่าสัมประสิทธิ์ของความล่าช้าในแบบจำลอง	51
สมการอัตราเงินเฟ้อ (สมการที่ 4.1)	55
สมการอัตราเงินเฟ้อ (สมการที่ 4.2)	59
สมการระดับผลผลิต (สมการที่ 4.3)	64
สมการระดับผลผลิต (สมการที่ 4.4)	68
บทที่ 5 สรุปและข้อเสนอแนะ	73
สรุป	73
ข้อเสนอแนะ	75
ข้อเสนอแนะที่ได้จากการศึกษาครั้งนี้	75
ข้อเสนอแนะสำหรับการศึกษาค้างต่อไป	76
เอกสารและสิ่งอ้างอิง	77
ภาคผนวก	81
ภาคผนวก ก การแก้สมการหาสมการอัตราเงินเฟ้อและระดับผลผลิต	82
ภาคผนวก ข การทดสอบคุณสมบัติความน่าเชื่อถือของข้อมูล	96
ภาคผนวก ค การตรวจสอบปัญหา Multicollinearity	103
ภาคผนวก ง การหาระดับ i และ r ที่เหมาะสมของสมการอัตราเงินเฟ้อ และสมการระดับผลผลิต	105
ภาคผนวก จ การประมาณค่าสัมประสิทธิ์ Polynomial Degree 0 ถึง 2 ของสมการอัตราเงินเฟ้อและสมการระดับผลผลิต	118
ภาคผนวก ฉ การตรวจสอบปัญหา Autocorrelation	121
ภาคผนวก ช ตัวแปรที่ใช้ในแบบจำลอง	124
ประวัติการศึกษาและการทำงาน	129

สารบัญตาราง

ตารางที่		หน้า
1	อัตราเงินเฟ้อและระดับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศช่วงปี พ.ศ. 2536-2547	3
2	ผลการทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของข้อมูล ณ ระดับ ความเชื่อมั่นที่ร้อยละ 90	51
3	ผลการทดสอบคุณสมบัติความล่าของข้อมูล ณ ระดับ ความเชื่อมั่นที่ร้อยละ 90	52
4	ผลการทดสอบค่า i และ r ของสมการอัตราเงินเฟ้อ (สมการที่ 4.1)	56
5	ผลการประมาณค่าสัมประสิทธิ์ Polynomial Degree 0 ถึง 2 ของสมการอัตราเงินเฟ้อ (สมการที่ 4.1)	57
6	ผลการประมาณ Lag Weights ของสมการอัตราเงินเฟ้อ (สมการที่ 4.1)	57
7	ผลการทดสอบค่า i และ r ของสมการอัตราเงินเฟ้อ (สมการที่ 4.2)	61
8	ผลการประมาณค่าสัมประสิทธิ์ Polynomial Degree 0 ถึง 2 ของสมการอัตราเงินเฟ้อ (สมการที่ 4.2)	62
9	ผลการประมาณ Lag Weights ของสมการอัตราเงินเฟ้อ (สมการที่ 4.2)	62
10	ผลการทดสอบค่า i และ r ของสมการระดับผลผลิต (สมการที่ 4.3)	65

สารบัญตาราง (ต่อ)

ตารางที่		หน้า
11	ผลการประมาณค่าสัมประสิทธิ์ Polynomial Degree 0 ถึง 2 ของสมการสมการระดับผลผลิต (สมการที่ 4.3)	66
12	ผลการประมาณ Lag Weights ของสมการระดับผลผลิต (สมการที่ 4.3)	67
13	ผลการทดสอบค่า i และ r ของสมการระดับผลผลิต (สมการที่ 4.4)	70
14	ผลการประมาณค่าสัมประสิทธิ์ Polynomial Degree 0 ถึง ของสมการระดับผลผลิต (สมการที่ 4.4)	70
15	ผลการประมาณ Lag Weights ของสมการระดับผลผลิต (สมการที่ 4.4)	71
ตารางผนวกที่		
1	การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของตัวแปร (π_t)	97
2	การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของตัวแปร (y_t)	97
3	การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของตัวแปร ($GM1_t$)	98
4	การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของตัวแปร ($GM2_t$)	99
5	การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของตัวแปร (G_t)	99
6	การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของตัวแปร (BP_t)	100

สารบัญตาราง (ต่อ)

ตารางผนวกที่	หน้า
7 การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของตัวแปร $(M1/P)_t$	101
8 การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของตัวแปร $(M2/P)_t$	101
9 การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของตัวแปร (g_t)	102
10 Correlation Matrix ของตัวแปรในสมการอัตราเงินเฟ้อ (สมการที่ 4.1)	104
11 Correlation Matrix ของตัวแปรในสมการอัตราเงินเฟ้อ (สมการที่ 4.2)	104
12 Correlation Matrix ของตัวแปรในสมการระดับผลผลิต (สมการที่ 4.3)	104
13 Correlation Matrix ของตัวแปรในสมการระดับผลผลิต (สมการที่ 4.4)	104
14 ผลการทดสอบค่า i และ r ของสมการอัตราเงินเฟ้อ (สมการที่ 4.1)	106
15 ผลการทดสอบค่า i และ r ของสมการอัตราเงินเฟ้อ (สมการที่ 4.2)	109
16 ผลการทดสอบค่า i และ r ของสมการระดับผลผลิต (สมการที่ 4.3)	112
17 ผลการทดสอบค่า i และ r ของสมการระดับผลผลิต (สมการที่ 4.4)	115
18 การประมาณค่าสัมประสิทธิ์ Polynomial Degree 0 ถึง 2 ของสมการ อัตราเงินเฟ้อ (สมการที่ 4.1) จำนวน Lag เท่ากับ 9	119

สารบัญตาราง (ต่อ)

ตารางผนวกที่		หน้า
19	การประมาณค่าสัมประสิทธิ์ Polynomial Degree 0 ถึง 2 ของสมการ อัตราเงินเฟ้อ (สมการที่ 4.2) จำนวน Lag เท่ากับ 9	119
20	การประมาณค่าสัมประสิทธิ์ Polynomial Degree 0 ถึง 2 ของสมการ ระดับผลผลิต (สมการที่ 4.3) จำนวน Lag เท่ากับ 10	120
21	การประมาณค่าสัมประสิทธิ์ Polynomial Degree 0 ถึง 2 ของสมการ ระดับผลผลิต (สมการที่ 4.4) จำนวน Lag เท่ากับ 7	120
22	การตรวจสอบปัญหา Autocorrelation ของสมการ อัตราเงินเฟ้อ (สมการที่ 4.1)	122
23	การตรวจสอบปัญหา Autocorrelation ของสมการ อัตราเงินเฟ้อ (สมการที่ 4.2)	122
24	การตรวจสอบปัญหา Autocorrelation ของสมการ ระดับผลผลิต (สมการที่ 4.3)	123
25	การตรวจสอบปัญหา Autocorrelation ของสมการ ระดับผลผลิต (สมการที่ 4.4)	123
26	ตัวแปรที่ใช้ในแบบจำลอง	125

สารบัญภาพ

ภาพที่

หน้า

1 แบบจำลอง IS-LM-BP ของระบบเศรษฐกิจแบบเปิด

19