

สารบัญ

	หน้า
บทคัดย่อ	(1)
กิตติกรรมประกาศ.....	(3)
สารบัญตาราง	(6)
สารบัญภาพประกอบ.....	(7)
 บทที่	
1. บทนำ.....	1
1.1 ความสำคัญของปัญหา.....	1
1.2 วัตถุประสงค์.....	9
1.3 ขอบเขตการศึกษา	9
1.4 วิธีการศึกษา	9
1.5 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ	10
1.6 โครงสร้างการศึกษา.....	10
 2. การดำเนินนโยบายการเงินและนโยบายอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศไทย	11
2.1 ความเป็นมาของนโยบายการเงิน.....	11
2.2 การทำงานของนโยบายการเงิน.....	13
2.3 การดำเนินนโยบายอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศไทย	14
 3. แนวคิดที่ใช้ในการศึกษาและวรรณกรรมปริทัศน์.....	26
3.1 แนวคิดที่ใช้ในการศึกษา	26
3.2 วรรณกรรมปริทัศน์	31

4. วิธีการศึกษา	52
4.1 Vector Autoregressive Model (VAR)	52
4.1.1 การเลือกกระดับ Lag ที่เหมาะสม	55
4.1.2 การทดสอบคุณสมบัติ Stationary	56
4.2 Identification Problem	59
4.3 Impulse Response Function	61
4.4 Variance Decomposition.....	62
5. ผลการศึกษา	65
5.1 การเลือกลักษณะของแบบจำลอง	65
5.1.1 ผลการทดสอบความมีเสถียรภาพของข้อมูล	65
5.1.2 ผลการทดสอบ Lag Length ของตัวแปร	68
5.2 การศึกษาความสัมพันธ์ระหว่างตัวแปรของแบบจำลอง VAR.....	70
5.2.1 ผลการประมาณค่าแบบจำลอง VAR.....	71
5.2.2 การวิเคราะห์การตอบสนองของตัวแปร	
(Impulse Respond Function)	73
5.2.3 การวิเคราะห์ขนาดของอิทธิพลของตัวแปรโดยการแยกส่วนของ	
ความแปรปรวน (Variance Decomposition).....	78
6. สรุปผลการศึกษาและข้อเสนอแนะ.....	95
6.1 สรุปผลการศึกษา	95
6.2 ข้อเสนอแนะ	97
ภาคผนวก	
ก. ข้อมูลตัวแปรที่ใช้ในการศึกษา	99
บรรณานุกรม	103