

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ก
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ณ
บทที่ 1 บทนำ	1
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	3
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา	3
1.4 ขอบเขตในการศึกษา	3
1.5 นิยามศัพท์	4
บทที่ 2 แนวคิด ทฤษฎี และผลงานการศึกษาที่เกี่ยวข้อง	5
2.1 แนวคิดและทฤษฎี	5
2.1.1 ทฤษฎีค่าเสมอภาคของอำนาจซื้อ	5
2.1.2 ทฤษฎีอนุพันธ์อัตราดอกเบี้ยในการประมาณค่าอัตราแลกเปลี่ยน	7
2.1.3 ทฤษฎีการทดสอบข้อมูล	9
2.1.3.1 การทดสอบ Unit Root	9
2.1.3.2 โคอินทิเกรชัน	10
2.1.3.3 โคอินทิเกรชันและแบบจำลองเอเรอร์คอร์เรคชัน	11
2.1.3.4 การทดสอบโคอินทิเกรชันโดยวิธีการของ Johansen และ Juselius	12
2.2 ผลงานการศึกษาที่เกี่ยวข้อง	13
บทที่ 3 ระเบียบและวิธีการศึกษา	19
3.1 แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา	19
3.2 วิธีการวิเคราะห์ข้อมูล	20
บทที่ 4 ผลการศึกษาปัจจัยที่มีอิทธิพลต่ออัตราแลกเปลี่ยน	23
4.1 กรณีบาทต่อดอลลาร์สหรัฐฯ	23

4.2	กรณียื่นต่อศาลรัฐธรรมนูญ	27
4.3	กรณีถอนต่อศาลรัฐธรรมนูญ	30
4.4	กรณีร้องกิตต่อศาลรัฐธรรมนูญ	33
4.5	กรณีฟิลิปปินส์เปโซต่อศาลรัฐธรรมนูญ	35
4.6	กรณีต่อศาลสิงคโปร์ต่อศาลรัฐธรรมนูญ	38
บทที่ 5	สรุปและข้อเสนอแนะ	42
5.1	สรุปผลการศึกษา	42
5.2	ข้อเสนอแนะ	43
	บรรณานุกรม	44
	ประวัติผู้เขียน	46

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
4.1 Unit Root Test ของตัวแปรต่าง ๆ ในกรณีบาทต่อคอลลาร์สหรัฐฯ ที่ระดับ level $I(0)$	23
4.2 Unit Root Test ของตัวแปรต่าง ๆ ในกรณีบาทต่อคอลลาร์สหรัฐฯ ที่ first difference	24
4.3 ผลการทดสอบหาจำนวน cointegrating vectors	25
4.4 Unit Root Test ของตัวแปรต่าง ๆ ในกรณีเยนต่อคอลลาร์สหรัฐฯ ที่ระดับ level $I(0)$	27
4.5 Unit Root Test ของตัวแปรต่าง ๆ ในกรณีเยนต่อคอลลาร์สหรัฐฯ ที่ first difference	28
4.6 ผลการทดสอบหาจำนวน cointegrating vectors	28
4.7 Unit Root Test ของตัวแปรต่าง ๆ ในกรณีวอนต่อคอลลาร์สหรัฐฯ ที่ระดับ level $I(0)$	30
4.8 Unit Root Test ของตัวแปรต่าง ๆ ในกรณีวอนต่อคอลลาร์สหรัฐฯ ที่ first difference	31
4.9 ผลการทดสอบหาจำนวน cointegrating vectors	31
4.10 Unit Root Test ของตัวแปรต่าง ๆ ในกรณีริงกิตต่อคอลลาร์สหรัฐฯ ที่ระดับ level $I(0)$	33
4.11 Unit Root Test ของตัวแปรต่าง ๆ ในกรณีริงกิตต่อคอลลาร์สหรัฐฯ ที่ first difference	33
4.12 ผลการทดสอบหาจำนวน cointegrating vectors	34
4.13 Unit Root Test ของตัวแปรต่าง ๆ ในกรณีฟิลิปปินส์เปโซต่อคอลลาร์สหรัฐฯ ที่ระดับ level $I(0)$	36
4.14 Unit Root Test ของตัวแปรต่าง ๆ ในกรณีฟิลิปปินส์เปโซต่อคอลลาร์สหรัฐฯ ที่ first difference	36
4.15 ผลการทดสอบหาจำนวน cointegrating vectors	37
4.16 Unit Root Test ของตัวแปรต่าง ๆ ในกรณีดอลลาร์สิงคโปร์ต่อคอลลาร์สหรัฐฯ ที่ระดับ level $I(0)$	39
4.17 Unit Root Test ของตัวแปรต่าง ๆ ในกรณีดอลลาร์สิงคโปร์ต่อคอลลาร์สหรัฐฯ ที่ first difference	39
4.18 ผลการทดสอบหาจำนวน cointegrating vectors	40