

ชื่อเรื่องการค้นคว้าแบบอิสระ การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการใช้จ่ายของรัฐบาล
กับการเติบโตทางเศรษฐกิจของประเทศไทย

ผู้เขียน นางสาวนิตานถ นิสากรเกรียงเดช

ปริญญา เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ

อ. ดร. นิสิต พันธมิตร	ประธานกรรมการ
อ. ดร. ไพรัช กาญจนการุณ	กรรมการ
รศ. ธเนศ ศรีวิชัยคำพันธ์	กรรมการ

บทคัดย่อ

การศึกษานี้ มีวัตถุประสงค์เพื่อทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการใช้จ่ายของรัฐบาลกับการเติบโตทางเศรษฐกิจของประเทศไทยทั้งในระยะสั้น และในระยะยาว โดยตัวแปรทางเศรษฐกิจที่นำมาพิจารณาศึกษาได้แก่ การใช้จ่ายของรัฐบาลที่เป็นตัวเงิน ผลผลิตทั้งหมดรวมภายในประเทศที่เป็นตัวเงิน และจำนวนประชากรของประเทศ โดยใช้ข้อมูลทศวรรษเป็นรายปี ตั้งแต่ปี พ.ศ. 2493 – 2546 โดยประยุกต์ใช้เทคนิคโคอินทิเกรชัน (Cointegration) แบบจำลองเอเรอร์คอร์เรคชัน (Error Correction Mechanism) และการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล (Granger Causality)

จากการทดสอบความนิ่งของข้อมูลทั้ง 4 ตัวแปร คือ การใช้จ่ายของรัฐบาล ผลผลิตทั้งหมดรวมภายในประเทศ สัดส่วนการใช้จ่ายของรัฐบาลต่อผลผลิตทั้งหมดรวมภายในประเทศ และผลผลิตทั้งหมดรวมภายในประเทศต่อคน พบว่าข้อมูลที่นำมาทดสอบมีความไม่นิ่ง (Non-stationary) และมีลักษณะข้อมูลแบบ $I(1)$ ณ ระดับนัยสำคัญที่ 0.01 จากนั้นทดสอบความสัมพันธ์ในระยะสั้น และระยะยาว พบว่าการใช้จ่ายของรัฐบาลและผลผลิตทั้งหมดรวมภายในประเทศ ทั้งสองตัวแปรมีความสัมพันธ์ในระยะสั้น และมีการปรับตัวเข้าสู่ดุลยภาพในระยะยาวทั้งสองทิศทางด้วยเช่นกัน ในส่วนของการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผลพบว่า ผลผลิตทั้งหมดรวมภายในประเทศและการใช้จ่ายของรัฐบาลมีความสัมพันธ์เป็นเหตุเป็นผลทั้งสองทิศทาง

สำหรับสัดส่วนการใช้จ่ายของรัฐบาลต่อผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศและผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศต่อคนนั้น พบว่าทั้งสองตัวแปรมีความสัมพันธ์ในระยะสั้น และมีการปรับตัวเข้าสู่ดุลยภาพในระยะยาวในทิศทางเดียว การทดสอบความเป็นเหตุเป็นผลพบว่า ผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศต่อคนและสัดส่วนการใช้จ่ายของรัฐบาลต่อผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ ที่มีความสัมพันธ์เป็นเหตุเป็นผลทั้งสองทิศทาง



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

Independent Study Title A Test of the Relationship Between Government Expenditure and Economic Growth of Thailand

Author Miss Nisanard Nisakornkreangdet

Degree Master of Economics

Independent Study Advisory Committee

Lect. Dr. Nisit Panthamit Chairperson

Lect. Dr. Pairut Kanjanakaroon Member

Assoc. Prof. Thanet Sriwichailamphan Member

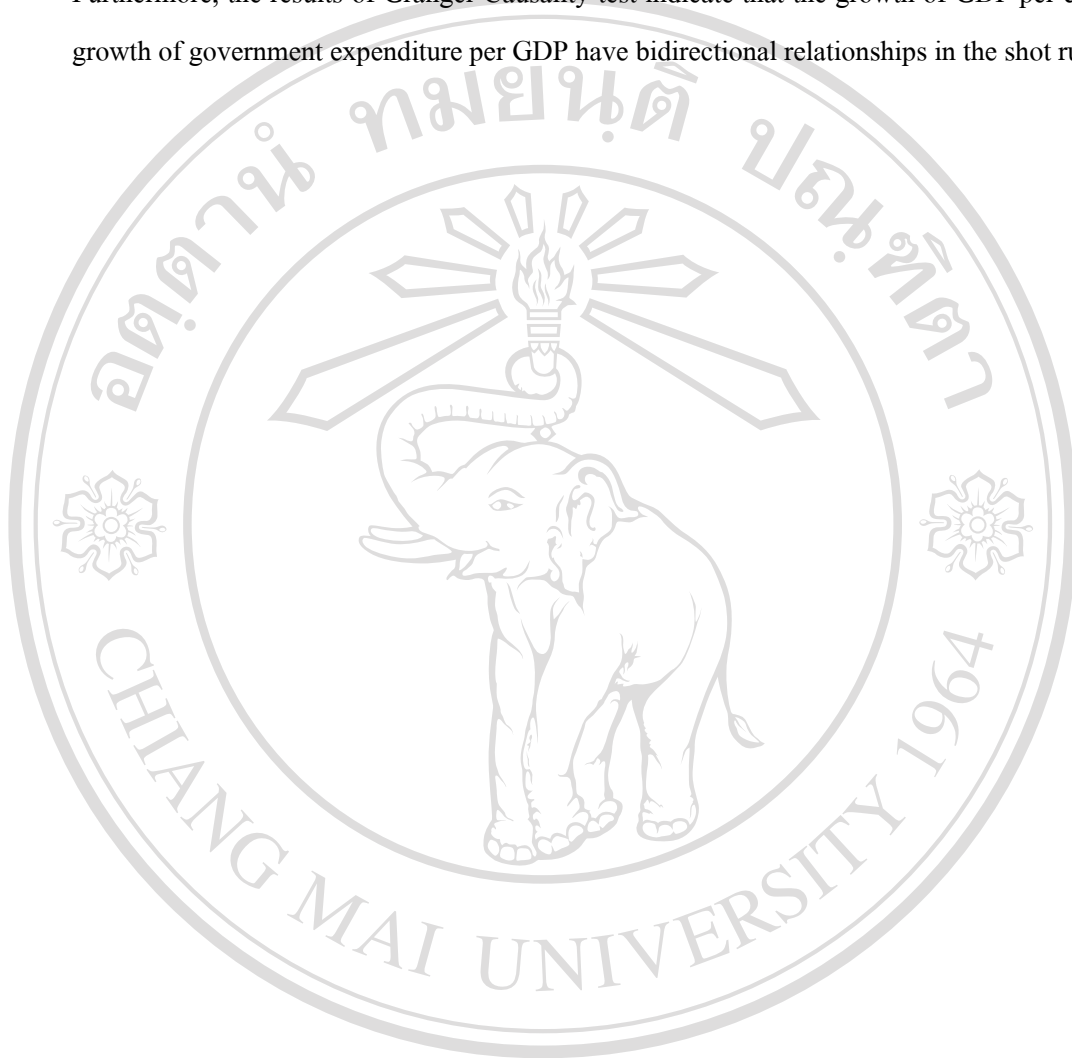
ABSTRACT

The purpose of this study is to examine a relationship between government expenditure and economic growth of Thailand by using data during 1950-2003. By examining a relationship in two functional forms: (1) government expenditure and GDP, and (2) government expenditure per GDP and GDP per capita, both short run and long run. Using the Engle and Granger cointegration test, the Error Correction Mechanism and the Granger Causality test are all applied in this study.

The results of unit root test found that all of variables are non-stationary and characterized by an I(1) process at the 1% level. Regarding to the cointegration test, the results indicate that government expenditure and GDP have bidirectional relationships in the long run. Moreover, the results of Granger Causality test show that the growth of GDP and growth of government expenditure have bidirectional relationships in the shot run, as well.

Likewise, the empirical evidences of cointegration test indicate that government expenditure per GDP and GDP per capita have unidirectional relationship in the long run.

Furthermore, the results of Granger Causality test indicate that the growth of GDP per capita and growth of government expenditure per GDP have bidirectional relationships in the short run.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved