

ชื่อเรื่องการค้าค้นคว้าแบบอิสระ การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างมูลค่าการค้า  
ชายแดนกับการเติบโตของปริมาณเงินของ  
จังหวัดเชียงราย

ผู้เขียน นางสาวสุวิชา ชมภูพาน

ปริญญา เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้าค้นคว้าแบบอิสระ

อ. ดร. นิสิต พันธมิตร

ประธานกรรมการ

อ. ดร. ไพรัช กาญจนการุณ

กรรมการ

รศ. ธเนศ ศรีวิชัยลำพันธ์

กรรมการ

บทคัดย่อ

การศึกษานี้ มีวัตถุประสงค์เพื่อที่จะหาความสัมพันธ์ระหว่างมูลค่าการค้าชายแดนกับการเติบโตของปริมาณเงินของจังหวัดเชียงราย โดยใช้ข้อมูลอนุกรมเวลารายเดือนตั้งแต่ปี 2541-2547 โดยในขั้นตอนแรกจะทำการทดสอบความนิ่งของข้อมูล หลังจากนั้นจึงทำการวิเคราะห์ความสัมพันธ์ในระยะสั้น – ระยะยาว และศึกษาถึงความเป็นเหตุเป็นผลระหว่างตัวแปรมูลค่าการค้าชายแดนและการเติบโตของปริมาณเงินของจังหวัดเชียงราย

จากผลการศึกษาพบว่าจากการทดสอบความนิ่งของข้อมูลของมูลค่าการค้าชายแดนและการเติบโตของปริมาณเงินของจังหวัดเชียงรายพบว่ามีความนิ่งภายหลังจากการทดสอบผลต่างลำดับที่ 1 (first difference) หรือ I(1) นอกจากนี้พบว่าทั้งสองตัวแปรมีความสัมพันธ์กันในระยะสั้นและระยะยาว ทั้งแบบจำลองที่ปริมาณเงินเป็นตัวแปรอิสระและมูลค่าการค้าชายแดนเป็นตัวแปรตาม และแบบจำลองที่มูลค่าการค้าชายแดนเป็นตัวแปรอิสระและปริมาณเงินเป็นตัวแปรตาม

ในส่วนของการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผลพบว่าการเติบโตของปริมาณเงินในจังหวัดเชียงรายจะเหตุทำให้เกิดการเปลี่ยนแปลงของมูลค่าการค้าชายแดน หรือมีแต่มูลค่าการค้าชายแดนกลับไม่เป็นเหตุต่อการเติบโตของปริมาณเงินของจังหวัดเชียงราย

**Independent Study Title** Testing of the Relationship Between Border Trade and Chiang Rai's Money Supply Growth

**Author** Miss Suwittha Chompuphan

**Degree** Master of Economics

**Independent Study Advisory Committee**

Lect. Dr.Nisit Panthamit Chairperson

Lect. Dr.Pairat Kanjanakaroon Member

Assoc. Prof.Tanes Sivichilumphan Member

**ABSTRACT**

The purpose of this study is to examine the relationship between border trade balance and Chiang Rai's money supply growth – for the period 1998-2004 by using cointegration and Granger causality techniques to examine a relationship between two variables, namely border trade balance and Chiang Rai's money supply. Firstly, the results of study show that both border trade balance and money supply variables are stationary after taking first difference or I(1). Moreover, the results show that they exist the short-run and long-run relationships of border trade and money supply variables in the model in which each variable is used as an explanatory variable. It also asserts that an increase in the Chiang Rai's money supply growth rate leads to decrease in border trade balance growth rate and vice versa.

Furthermore, the empirical results indicate that in the short run, the rate of trade balance and money supply converge to their long – run equilibriums. The causality test utilized in this study also indicates that the money supply growth rate causes the border trade balance, while border trade balance growth rate does not cause Chiang Rai's money supply.