

ชื่อเรื่องการค้นคว้าแบบอิสระ การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการออมของภาค
ครัวเรือนกับการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของ
ประเทศไทย

ผู้เขียน นางสาวณัฏฐา ทิศแจ่ม

ปริญญา เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ

อ. ดร.ประพัฒน์ จริยะพันธ์ ประธานกรรมการ
อ. ดร.ไพรัช กาญจนการุณ กรรมการ
ผศ. ดร.นิสิต พันธมิตร กรรมการ

บทคัดย่อ

การศึกษานี้มีวัตถุประสงค์เพื่อทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการออมของภาค
ครัวเรือนกับการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของประเทศไทย โดยตัวแปรทางเศรษฐกิจที่นำมา
พิจารณาศึกษา ได้แก่ การออมของภาคครัวเรือน และผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ โดยใช้
ข้อมูลทศวรรษรายไตรมาสครอบคลุมตั้งแต่ พ.ศ. 2541/ ไตรมาส 1 – พ.ศ. 2548/ ไตรมาส 4 โดย
ประยุกต์ใช้เทคนิคทางเศรษฐมิติ ได้แก่ การทดสอบโคอินทิเกรชัน (cointegration) แบบจำลองเอ
เรอร์คอร์เรคชัน (error correction mechanism) และการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล (Granger
Causality) จากผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูลทั้งสองตัวแปร คือ การออมของภาคครัวเรือน และ
ผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ พบว่าตัวแปรทุกตัวมี order of integration เดียวกัน คือ $I(1)$ ณ
ระดับนัยสำคัญที่ 0.01 จากนั้นทดสอบความสัมพันธ์ระยะยาว พบว่าทั้งสองตัวแปรมีความสัมพันธ์
กันในระยะยาว และเมื่อทดสอบขบวนการปรับตัวในระยะสั้น พบว่าในกรณีที่การออมของภาค
ครัวเรือนเป็นตัวแปรต้น และผลิตภัณฑ์มวลรวมในประเทศเป็นตัวแปรตามแบบจำลองมีการ
ปรับตัวในระยะสั้น แต่ในกรณีที่ผลิตภัณฑ์มวลรวมในประเทศเป็นตัวแปรต้น และการออมของภาค
ครัวเรือนเป็นตัวแปรตามแบบจำลองไม่มีการปรับตัวในระยะสั้น ในส่วนของการทดสอบความเป็น
เหตุเป็นผลพบว่า ตัวแปรทั้งสองมีความสัมพันธ์กันแบบสองทิศทาง

Independent Study Title A Test of the Relationship between Household Saving and Economic Growth of Thailand

Author Miss Naratchada Tidjam

Degree Master of Economics

Independent Study Advisory Committee

Lect. Dr. Prapatchon Jariyapan Chairperson

Lect. Dr. Pairat Kanjanakaroon Member

Asst. Prof. Dr. Nisit Panthamit Member

ABSTRACT

The purpose of this study was to examine the relationship between household saving and the economic growth of Thailand, using the economic variables of household saving and GDP during 1998/quarterly 1 – 2005/quarterly 4. Econometric methods applied in this research were Cointegration, Error Correction Mechanism and Granger Causality.

According to the unit root test of both variables, household saving and GDP, all variables had the same order of integration, (1) process at the 1% level. Regarding the cointegration test, the results indicated that household saving and GDP had a bidirectional relationship in the long run. In the error correction mechanism test, household saving was an independent variable and GDP a dependent one with a short run relationship. However, GDP is an independent variable and household saving a dependent one with no short run relationship. In addition, the Granger Causality test showed that both variables had a bidirectional relationship.