

ชื่อเรื่องการค้าค้นคว้าแบบอิสระ

ผลกระทบของอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงต่อมูลค่าการส่ง
ออกสินค้าเกษตรของไทย

ผู้เขียน

นางสาวสุกิริยา เตชะนันท์

ปริญญา

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้าค้นคว้าแบบอิสระ

ผศ.ดร.นิสิต พันธมิตร

ประธานกรรมการ

รศ.ดร.ชเนศ ศรีวิชัยลำพันธ์

กรรมการ

ผศ.ดร.ไพรัช กาญจนการุณ

กรรมการ

บทคัดย่อ

การศึกษานี้มีวัตถุประสงค์เพื่อศึกษาถึงผลกระทบของอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงต่อมูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรของไทย โดยทำการวิเคราะห์ของความสัมพันธ์ระหว่างบทบาทรายได้ประชาชาติของไทย รายได้ประชาชาติของประเทศคู่ค้าที่สำคัญ และอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงที่มีต่อมูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรของไทย ด้วยการประยุกต์ใช้เทคนิควิธีโคอินทิเกรชัน และแบบจำลองเอเรอร์คอร์เรชัน โดยที่ประเทศคู่ค้าที่สำคัญของไทยได้แก่ ประเทศสหรัฐฯ ญี่ปุ่น ออสเตรเลีย เกาหลีใต้ เดนมาร์ก เยอรมนี และสหราชอาณาจักร สำหรับข้อมูลที่ใช้เป็นข้อมูลทุติยภูมิรายไตรมาส ตั้งแต่ช่วงปี พ.ศ. 2540 ถึงปี พ.ศ. 2549

ผลการศึกษาพบว่าความสัมพันธ์ระหว่างบทบาทรายได้ประชาชาติของไทย รายได้ประชาชาติของประเทศคู่ค้าที่สำคัญ และอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงที่มีต่อมูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรของไทย ผลการศึกษาพบว่ามีนัยสำคัญทางสถิติ และอธิบายผลกระทบในระยะยาวได้ดังต่อไปนี้

ค่าสัมประสิทธิ์ของตัวแปรรายได้ประชาชาติของไทย ทั้ง 7 กรณี อันได้แก่ ไทยกับสหรัฐอเมริกา ไทยกับญี่ปุ่น ไทยกับออสเตรเลีย ไทยกับเกาหลีใต้ ไทยกับเดนมาร์ก ไทยกับเยอรมนี และไทยกับสหราชอาณาจักร ได้ค่าเท่ากับ -2.5548 1.0717 1.3637 0.56758 -3.8188 0.16973 และ 0.64464 ตามลำดับ

บทบาทรายได้ประชาชาติของประเทศคู่ค้าที่สำคัญที่มีต่อมูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรของไทยพบว่าค่าสัมประสิทธิ์ของตัวแปรรายได้ประชาชาติประเทศคู่ค้าที่สำคัญทั้ง 7 กรณี อันได้แก่ ไทยกับสหรัฐอเมริกา ไทยกับญี่ปุ่น ไทยกับออสเตรเลีย ไทยกับเกาหลีใต้ ไทยกับแคนาดา ไทยกับเยอรมนี และไทยกับสหราชอาณาจักร ได้ค่าเท่ากับ 4.7885 -2.6093 -0.8186 2.0510 8.5321 1.9928 และ -12.0709 ตามลำดับ

บทบาทอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงที่มีต่อมูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรของไทยพบว่าค่าสัมประสิทธิ์ของอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงทั้ง 7 กรณี อันได้แก่ ไทยกับสหรัฐอเมริกา ไทยกับญี่ปุ่น ไทยกับออสเตรเลีย ไทยกับเกาหลีใต้ ไทยกับแคนาดา ไทยกับเยอรมนี และไทยกับสหราชอาณาจักร ได้ค่าเท่ากับ -1.0207 -0.72735 -0.79658 -0.75507 -2.3724 -0.26706 และ 28.6879 ตามลำดับ

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

Independent Study Title Effects of Real Exchange Rate on Agricultural Exports of
Thailand

Author Miss Supeeriya Techanant

Degree Master of Economics

Independent Study Advisory Committee

Asst.Prof.Dr.Nisit Panthamit

Chairperson

Assoc.Prof.Dr.Thanes Sriwichailamphan

Member

Asst.Prof.Dr. Prirat Kanjanakaroon

Member

ABSTRACT

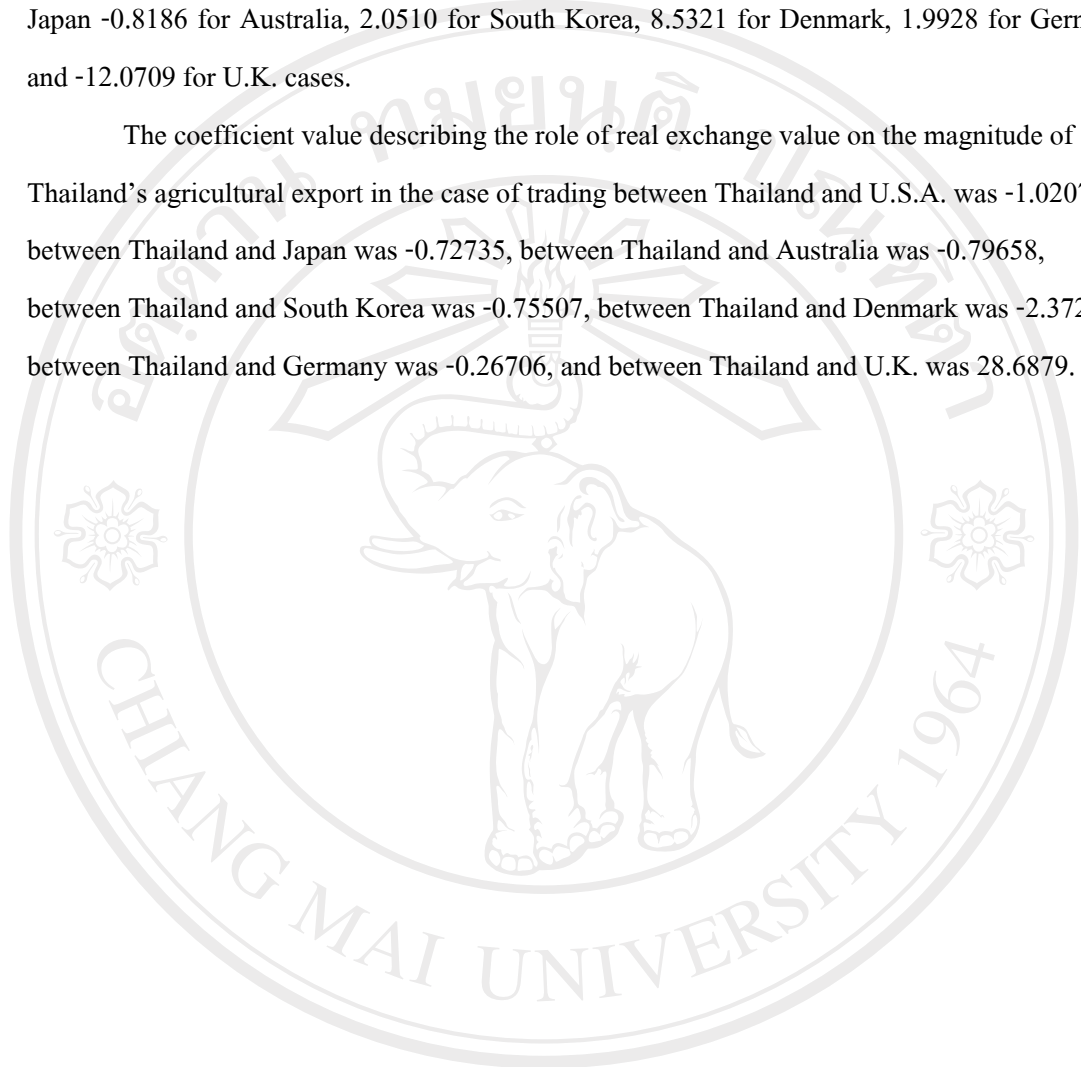
The study aimed to examine the impact of real exchange rate on agricultural export value of Thailand specifically it analyzed the long-run equilibrium relationships between such variables as Thailand's national income and those of Thailand's major trading partner, the real exchange rate and the agricultural export value of Thailand. Cointegration technique and ECM (Error Correction Model) Method were applied for this study. U.S.A, Japan, Australia, South Korea, Denmark, Germany and U.K. were considered Thailand's major trading partners. The examination was base on secondary data covering 1997–2006.

The study found that in the long-run the role of Thailand's national income, the major trading partners' national income as well as the real exchange rate had statistically significant impact on Thailand's agricultural export values as summarized below.

The coefficients of relationship between Thailand's national income and agricultural export values in the case of U.S.A, Japan, Australia, South Korea, Denmark, Germany and U.K. had the values of -2.5548, 1.0717, 1.3637, 0.56758, -3.8188, 0.16973 and 0.64464, respectively.

The coefficient values explaining the role of trading partners' national income on Thailand's agricultural export values were found to be 4.7885 for the case of U.S.A., -2.6093 for Japan -0.8186 for Australia, 2.0510 for South Korea, 8.5321 for Denmark, 1.9928 for Germany and -12.0709 for U.K. cases.

The coefficient value describing the role of real exchange value on the magnitude of Thailand's agricultural export in the case of trading between Thailand and U.S.A. was -1.0207, between Thailand and Japan was -0.72735, between Thailand and Australia was -0.79658, between Thailand and South Korea was -0.75507, between Thailand and Denmark was -2.3724, between Thailand and Germany was -0.26706, and between Thailand and U.K. was 28.6879.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved