

ชื่อเรื่องการค้นคว้าแบบอิสระ การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างรายได้จากการท่องเที่ยวของประเทศไทย และการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของประเทศ โดยวิธีโคอินทิเกรชัน

ผู้เขียน

นางสาวพรรณี ญาณะตื้อ

ปริญญา

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ

ผศ.ดร.ไพรัช กาญจนการุณ

ประธานกรรมการ

ผศ.ดร.นิสิต พันธมิตร

กรรมการ

รศ.ดร.ชเนศ ศรีวิชัยลำพันธ์

กรรมการ

บทคัดย่อ

การศึกษานี้มีวัตถุประสงค์เพื่อศึกษาความสัมพันธ์ระหว่างรายได้จากการท่องเที่ยวของประเทศไทยและการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของประเทศ โดยวิธีโคอินทิเกรชัน ซึ่งตัวแปรที่นำมาศึกษาและพิจารณาได้แก่ รายได้จากการท่องเที่ยวของประเทศไทย และผลิตภัณฑ์มวลรวมของประเทศไทย และเป็นข้อมูลแบบทศนิยมโดยได้เก็บเป็นรายไตรมาส ในช่วงปี พ.ศ. 2541 – 2550 การวิเคราะห์ครั้งนี้ได้ทำการทดสอบยูนิทรูท (unit root) หรือการทดสอบความนิ่งของข้อมูล หลังจากนั้นจึงทำการทดสอบการร่วมไปด้วยกัน (cointegration test) ทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพในระยะสั้นเข้าสู่ดุลยภาพในระยะยาว (error correction mechanism) และการทดสอบเชิงเหตุเป็นผล (causality test) ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูลทั้ง 2 ตัวแปร คือ รายได้จากการท่องเที่ยวของประเทศไทย และผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ พบว่าข้อมูลที่นำมาทดสอบมีลักษณะไม่นิ่ง (non-stationary) และมีลักษณะข้อมูลเป็นระดับ $I(1)$ ณ ระดับนัยสำคัญ 0.01 จากนั้นทำการทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพในระยะสั้น และระยะยาว พบว่ารายได้จากการท่องเที่ยวของประเทศไทย และผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศมีความสัมพันธ์กันในระยะสั้น และมีการปรับตัวเข้าสู่ดุลยภาพในระยะยาว ซึ่งเป็นไปในสองทิศทาง และในส่วนของ การทดสอบเชิงเหตุเป็นผล พบว่ารายได้จากการท่องเที่ยวของประเทศไทย และผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศมีความเป็นเหตุเป็นผลกันทั้งสองทิศทาง

Independent Study Title Analysis of Relationship Between Tourism Income and Economic Growth of Thailand Using Cointegration Method

Author Miss Phunnee Yanatue

Degree Master of Economics

Independent Study Advisory Committee

Asst.Prof.Dr.Pirat Kanjanakaroon Chairperson

Asst.Prof.Dr.Nisit Panthamit Member

Assoc.Prof.Dr.Thanes Sriwichailamphan Member

ABSTRACT

The purpose of this study is to analyze the relationship between tourism income and economic growth of Thailand. The quarterly data during 1998-2007 in logarithms on real tourism income and real Gross Domestic Product are collected for the study. Since the data are time series, stationary test is conducted. This study employs the Cointegration test and Error Correction Mechanism(ECM) to analyze the long-run and short-run relationship between two variables. Granger Causality test were also applied in this study.

The results of unit root test reveal that both real tourism income and real Gross Domestic Product variables are non-stationary and have order of integration with I(1) process. According to the Cointegration test and Error Correction Mechanism, the results indicate that tourism income and economic growth have bidirectional the relationship in both long-run and short-run. Moreover, the results of Granger Causality show that tourism income and economic growth also have bidirectional relationship.