

ชื่อเรื่องการค้าค้นคว้าแบบอิสระ การเปรียบเทียบปัจจัยที่มีผลต่อการส่งออกของไทยไป
ยังประเทศสหรัฐอเมริกาและกลุ่มประเทศบรีค
โดยวิธีโคอินทิเกรชัน

ผู้เขียน นางสาวณัฐชิตา ศรีสกุล

ปริญญา เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้าค้นคว้าแบบอิสระ

ผศ.ดร.ไพรัช กาญจนการุณ

ผศ.ดร.นิสิต พันธมิตร

ประธานกรรมการ
กรรมการ

บทคัดย่อ

การศึกษาค้นคว้าครั้งนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อศึกษา ถึงปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อการส่งออกของ
ประเทศประเทศไทยไปกลุ่มประเทศบรีค ได้แก่ บราซิล รัสเซีย อินเดีย จีน และสหรัฐอเมริกา
รวมถึงการศึกษาหาความสัมพันธ์ระหว่างมูลค่าการส่งออกของประเทศไทยไปต่างประเทศกับอัตรา
แลกเปลี่ยนของต่างประเทศเทียบกับประเทศไทย ดัชนีราคาผู้บริโภคในประเทศและต่างประเทศ
โดยเปรียบเทียบ และดัชนีผลผลิตอุตสาหกรรมในประเทศไทยและต่างประเทศโดยเปรียบเทียบ
โดยได้นำวิธีโคอินทิเกรชันและแบบจำลองเอเรอร์คอร์เรชันมาประยุกต์ใช้กับแบบจำลองในการ
หาความสัมพันธ์ของมูลค่าการส่งออก สำหรับข้อมูลที่ใช้ในการศึกษาเป็นข้อมูลรายเดือน ตั้งแต่
เดือน กุมภาพันธ์ 2539 ถึง ธันวาคม พ.ศ. 2551

จากการศึกษาถึงปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อมูลค่าการส่งออกของสินค้าไทยไปสู่ต่างประเทศ
และการทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างมูลค่าการส่งออกของสินค้าไทยไปสู่ต่างประเทศกับอัตรา
แลกเปลี่ยนของต่างประเทศเทียบกับประเทศไทย ดัชนีราคาผู้บริโภคในประเทศและต่างประเทศ
โดยเปรียบเทียบ และดัชนีผลผลิตอุตสาหกรรมในประเทศไทยและต่างประเทศโดยเปรียบเทียบ
โดยแบ่งการทดสอบเป็น 5 ประเทศ ได้แก่ ไทยต่อบราซิล ไทยต่อรัสเซีย ไทยต่ออินเดีย ไทยต่อจีน

และไทยต่อสหรัฐฯ พบว่าทุกๆกรณีตัวแปรทุกตัวที่ใช้ในการทดสอบมีลักษณะไม่นิ่ง และในระยะยาว อัตราแลกเปลี่ยนของต่างประเทศเทียบกับประเทศไทย ดัชนีราคาผู้บริโภคในประเทศและต่างประเทศโดยเปรียบเทียบ และดัชนีผลผลิตอุตสาหกรรมในประเทศไทยและต่างประเทศโดยเปรียบเทียบ ต่างมีความสัมพันธ์กับมูลค่าการส่งออกของสินค้าไทยไปสู่ต่างประเทศอย่างมีนัยสำคัญ โดยส่วนเบี่ยงเบนออกไปนั้นจะมีค่าลดลงเรื่อยๆ ในแต่ละช่วงเวลา



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

Independent Study Title	A Comparison of Factors Affecting the Thai Exports to the U.S. and BRIC Countries by Cointegration Method				
Author	Miss Chananchidar Srisakun				
Degree	Master of Economics				
Independent Study Advisory Committee	<table border="0" style="width: 100%;"> <tr> <td style="width: 60%;">Asst.Prof.Dr.Pairat Kanjanakaroon</td> <td style="width: 40%;">Chairperson</td> </tr> <tr> <td>Asst.Prof.Dr.Nisit Panthmit</td> <td>Member</td> </tr> </table>	Asst.Prof.Dr.Pairat Kanjanakaroon	Chairperson	Asst.Prof.Dr.Nisit Panthmit	Member
Asst.Prof.Dr.Pairat Kanjanakaroon	Chairperson				
Asst.Prof.Dr.Nisit Panthmit	Member				

ABSTRACT

This objectives of this study were to investigate factors affecting the changes in the Thai Exports to the U.S. and BRIC Countries: Barzil, Russia, India, and China, and to examine the relationships between Thai export value and exchange rates, consumer price indices relative in comparison: CPI and Industry product indices relative: IPI. This study employed the Cointegration and Error Correction Model (ECM) along with the export model for the analysis. The empirical results showed that the monthly data of Thai Export to the US, Thai Export to Barzil, Thai Export to Russia, Thai Export to India, and Thai Export to China during February 1996 to December 2008 over 12 years were non-stationary. The empirical evidences also revealed that the Thai exports did not respond only to the changes in macroeconomic variables such as exchange rates, consumer price indices relative: CPI, and Industry product indices relative : IPI but also to the “disequilibrium error” in previous period. In the long run, the Thai export value and exchange rates, consumer price indices relative: CPI and Industry product indices relative in comparison: IPI in all cases.