

ชื่อเรื่องการค้นคว้าแบบอิสระ การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างผลิตภัณฑ์มวลรวม
ประชาชาติที่แท้จริง และอัตราการว่างงานของ
ประเทศไทย

ผู้เขียน นางสาวเสาวลักษณ์ ปิ่นชัย

ปริญญา เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ

ผศ.ดร. นิสิต พันธมิตร

อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก

ผศ.ดร. ไพรัช กาญจนการุณ อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

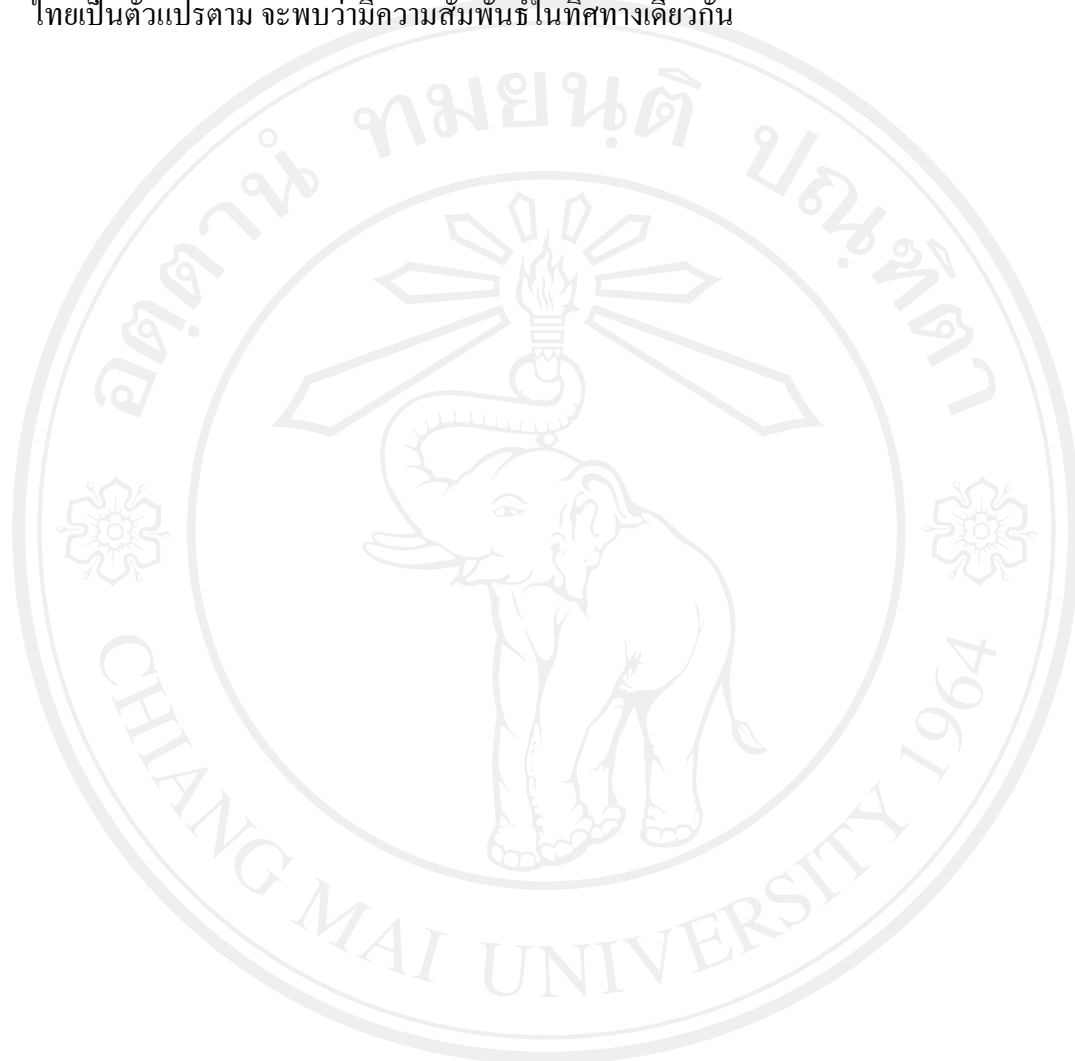
บทคัดย่อ

การศึกษานี้มีวัตถุประสงค์เพื่อ ทำการทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างผลิตภัณฑ์มวลรวม
ประชาชาติที่แท้จริง และอัตราการว่างงานของประเทศไทย โดยใช้ข้อมูลทุติยภูมิอนุกรมเวลา (Time
Series) แบบรายไตรมาส ตั้งแต่ไตรมาสแรกของปี 2536 ถึงไตรมาสสุดท้ายของปี 2552 รวมทั้งสิ้น
64 ข้อมูล ประกอบด้วยตัวแปร 2 ตัวแปร คือ ผลิตภัณฑ์มวลรวมประชาชาติที่แท้จริง และ อัตราการ
ว่างงานของประเทศไทย ได้ทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit root test) ด้วยวิธี Augmented Dickey
Fuller ทดสอบความเป็นเหตุเป็นผลด้วยวิธี Granger Causality และทดสอบความสัมพันธ์ของตัว
แปรด้วยวิธีกำลังสองน้อยที่สุด (OLS)

ผลการทดสอบ ความนิ่งของข้อมูล (Unit root test) ด้วยวิธี Augmented Dickey Fuller
พบว่า ข้อมูลผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ ที่แท้จริง และ อัตราการว่างงานของประเทศไทย มี
ลักษณะนิ่งที่ระดับ Level (I(0)) อย่างมีนัยสำคัญทางสถิติที่ระดับ 5%

ผลการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผลด้วยวิธี Granger Causality และผลการทดสอบ
ความสัมพันธ์ด้วยวิธี กำลังสองน้อยที่สุด มีความสอดคล้องกัน พบว่า การเปลี่ยนแปลงของ
ผลิตภัณฑ์มวลรวมประชาชาติที่แท้จริงเป็นสาเหตุของอัตราการว่างงานของประเทศไทย และอัตรา
การว่างงานของประเทศไทยก็เป็นสาเหตุของผลิตภัณฑ์มวลรวมประชาชาติที่แท้จริง เมื่อกำหนดให้
อัตราการว่างงาน ของประเทศไทย เป็นตัวแปรต้น และผลิตภัณฑ์มวลรวมประชาชาติที่แท้จริงเป็น

ตัวแปรตาม ที่ระดับนัยสำคัญ 0.05 พบว่ามีความสัมพันธ์กันในทิศทางตรงกันข้าม แต่หากกำหนดให้ผลิตภัณฑ์มวลรวมประชาชาติที่แท้จริงเป็นตัวแปรต้น และอัตราการว่างงานของประเทศไทยเป็นตัวแปรตาม จะพบว่ามีความสัมพันธ์ในทิศทางเดียวกัน



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

Independent Study Title	A Test of the Relationship Between Real Gross Domestic Product and Unemployment Rate of Thailand
Author	Miss Saowaluck Punchai
Degree	Master of Economics
Independent Study Advisory Committee	
	Assoc.Prof.Dr.Nisit Panthamit Advisor
	Assoc.Prof.Dr.Pairut Kanjanakaroon Co-advisor

ABSTRACT

This test of relationship between real GDP and unemployment rate of Thailand was based on secondary quarterly time series data of the two variables from the first quarter of 1993 to the last quarter of 2009, covering 64 observations.

The time series were subject to Unit Roots test by Augmented Dickey Fuller method for stationarity, causality test by Granger method for causal relationship and Ordinary Least Squares (OLS) analysis for the nature of relationship.

The results of Unit Roots test indicated both sets of time series were stationary at level (I(0)) at 0.05 statistically significant level.

The Granger Causality test and the OLS regression yielded a conforming result that there existed two-way relationships between the two variables at 0.05 statistically significant level. Specifically, the change in the unemployment rate would lead to the change in real GDP in the opposite direction while the change in real GDP would cause the change in the unemployment rate in the same direction.