

ชื่อเรื่องการค้นคว้าแบบอิสระ

ปัจจัยที่ส่งผลกระทบต่อ การส่งออกอัญมณีและ
เครื่องประดับไปยังประเทศส่งออกหลักของประเทศไทย โดยวิธีพาแนลโคอินทิเกรชัน

ผู้เขียน

นางสาววิรัชญา อนันตกรณีวัฒน์

ปริญญา

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ

อ.ดร.กัญสุดา นิ่มอนุสรณ์กุล อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก
อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์กุล อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

บทคัดย่อ

การศึกษาครั้งนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อศึกษาปัจจัยที่ส่งผลกระทบต่อ การส่งออกอัญมณีและเครื่องประดับของประเทศไทยไปยังประเทศส่งออกหลักของประเทศไทย ได้แก่ สวิตเซอร์แลนด์ ฮอลแลนด์ ออสเตรเลีย และสหรัฐอเมริกา รวมถึงการศึกษาหาความสัมพันธ์ระหว่างตัวแปร โดยใช้วิธีการวิเคราะห์พาแนลโคอินทิเกรชัน ซึ่งใช้ข้อมูลทศวรรษไตรมาส ตั้งแต่ไตรมาสที่ 1 ปี พ.ศ. 2544 ถึงไตรมาสที่ 4 ปี พ.ศ. 2553 รวม 40 ไตรมาส จำนวน 160 ค่าสังเกต ได้กำหนดให้อัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อสกุลเงินตราต่างประเทศ ผลัดกันข้ามรวมประชาชาติของต่างประเทศ ดัชนีราคาผู้บริโภคโดยเปรียบเทียบของไทยและต่างประเทศเป็นตัวแปรอิสระ และมูลค่าการส่งออกอัญมณีและเครื่องประดับเป็นตัวแปรตาม ขั้นตอนการวิเคราะห์ข้อมูลมีทั้งหมด 4 ขั้นตอน ได้แก่ การทดสอบข้อมูลโคอินทิเกรชัน การทดสอบพาแนลโคอินทิเกรชัน การทดสอบสมการพาแนล และการประมาณค่าแบบจำลองพาแนล

จากผลการทดสอบพาแนลยูนิทรูพบว่าตัวแปรทุกตัวมีความนิ่งที่อันดับความสัมพันธ์ของข้อมูลเท่ากับ 1 ผลการทดสอบพาแนลโคอินทิเกรชันพบว่าตัวแปรทุกตัวมีความสัมพันธ์กันในระยะยาว ผลการทดสอบสมการพาแนลพบว่าควรทำการประมาณค่าแบบจำลองในรูปแบบตัวแปรอิทธิพลคงที่ การประมาณค่าแบบจำลองพาแนลทั้งหมด 3 วิธี ได้แก่ วิธีกำลังสองน้อยที่สุด วิธีกำลังสองน้อยที่สุดเชิงพลวัต และวิธีการประมาณค่าแบบโมเมนต์ในรูปทั่วไป พบว่า

การประมาณค่าโดยวิธีกำลังสองน้อยที่สุด มีความเหมาะสมมากที่สุด จากการเปรียบเทียบค่าสัมประสิทธิ์การตัดสินใจปรับแก้ โดยผลิตภัณฑ์มวลรวมประชาชาติมีความสัมพันธ์กับมูลค่าการส่งออกอัญมณีและเครื่องประดับในทิศทางเดียวกัน ส่วนอัตราแลกเปลี่ยนและดัชนีราคาผู้บริโภคโดยเปรียบเทียบของไทยและต่างประเทศมีความสัมพันธ์กับมูลค่าการส่งออกอัญมณีและเครื่องประดับในทิศทางตรงกันข้าม และเนื่องจากสินค้าอัญมณีและเครื่องประดับจัดเป็นสินค้าประเภทฟุ่มเฟือยจึงมีค่าความยืดหยุ่นของอุปสงค์มาก



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

Independent Study Title Factors Affecting the Export of Thai Gem and Jewelry to Major Export Countries Using Panel Cointegration

Author Miss Vitanya Anantakoraneewat

Degree Master of Economics

Independent Study Advisory Committee

Lect. Dr. Kunsuda Nimanussornkul Advisor

Lect. Dr. Chaiwat Nimanussornkul Co-advisor

ABSTRACT

This study aimed to investigate factors affecting the export of Thai gems and jewelry to major import countries which are Switzerland, Hong Kong, Australia and United States during the first quarter of 2000 to the fourth quarter of 2010 (over 40 periods). A total of 160 observations were used with the constructed export model and panel cointegration as an analysis instrument to examine the relationship between variables. The set up exchange rate, gross domestic product and consumer price indices relative in comparison were employed for independent variables to predict the coefficient and direction of the dependent variable which is the export value of Thai gems and jewelry. There were 4 steps in the research methodology comprising the panel unit root test, panel cointegration test, panel equation test and model estimation.

The results of the panel unit root test indicated that all variables were stationary and had an order of integration equal to 1. The panel cointegration test revealed long term relationships among variables. The test of the panel equation suggested that the Fixed effects model would be suitable for this export model. The estimation using Ordinary Least Squares, Dynamic Ordinary Least Squares and Generalized Method of Moments found that Ordinary Least Square was the appropriate estimator model for this study, by comparing the Adjusted R-Square values. Gross

domestic product and export value have a positive relationship but the exchange rate and consumer price indices relative in comparison had a negative relationship with the export value of Thai gems and jewelry. Furthermore, demand is elastic due to the fact that gems and jewelry are luxury goods.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved