

ชื่อเรื่องวิทยานิพนธ์

ปัจจัยที่มีผลต่อการส่งออกสินค้าเกษตรที่สำคัญของไทย
โดยวิธีแพเนล โคอินทิเกรชัน

ผู้เขียน

นางสาวฐิตาพร ลีละวัฒน์พันธ์

ปริญญา

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์

อ.ดร.ชูเกียรติ ชัยบุญศรี

อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก

อ.ดร.อนุภาค เสาร์เสาวภาคย์

อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

รศ.ดร.ประเสริฐ ไชยทิพย์

อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

บทคัดย่อ

ในการศึกษาวิจัยครั้งนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อศึกษาปัจจัยที่ส่งผลกระทบต่อมูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรที่สำคัญของประเทศไทยและวิเคราะห์ความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาวระหว่างมูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรที่สำคัญของประเทศไทย กับปัจจัยที่มีผลต่อการส่งออกสินค้าเกษตร ไปยังประเทศคู่ค้าหลัก 5 ประเทศ ซึ่งประเทศไทยมีการส่งออกสินค้าเกษตรมากที่สุด 5 อันดับแรกได้แก่ จีน ญี่ปุ่น สหรัฐอเมริกา มาเลเซีย และเกาหลี โดยชนิดของสินค้าเกษตรที่เลือกทำการศึกษา ได้แก่ ยางพารา ข้าว ผลิตภัณฑ์จากมันสำปะหลัง และกุ้งแช่เย็น แช่แข็ง โดยใช้ข้อมูลทศวรรษปฏิวัติตั้งแต่ปี พ.ศ.2544 ถึง พ.ศ. 2553 ซึ่งในการศึกษาขั้นแรกทดสอบแพเนลยูนิตรูทด้วยวิธี Levin, Lin, and Chu Test (2002), Breitung Test (2001), Im, Pesaran and Shin Test (2003), Fisher-Type Test (1999) (including Fisher-ADF Test and Fisher-PP Test) and Hadri Test (2000) ต่อมาได้ทำการทดสอบแพเนล โคอินทิเกรชันด้วยวิธีของ Pedroni แล้วจึงทำการเปรียบเทียบระหว่างการทดสอบ Fixed Effect และ Random Effect ด้วยวิธี Huaman Test และ Redundant Fixed Effect Test จากนั้นทำการประมาณค่าความสัมพันธ์ระยะยาวของแบบจำลองมูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรของประเทศไทย ด้วยวิธีการโมเมนต์ในรูปทั่วไป (General Method of Moment: GMM) วิธี Ordinary Least Square (OLS) Dynamic Ordinary Least Square (DOLS) และ Fully Modified Ordinary Least Square (FMOLS) ผลการศึกษาความสัมพันธ์ระยะยาวชี้ว่า ปัจจัยที่มีผลต่อมูลค่าการส่งออกยางพาราได้แก่

ราคาสินค้าภายในประเทศ ราคาสินค้าส่งออก ผลิตภัณฑ์มวลรวมในประเทศ (Gross Domestic Products: GDP) ของประเทศคู่ค้า และปริมาณผลผลิต ในส่วนของ ปัจจัยที่มีผลต่อมูลค่าการส่งออกข้าว ได้แก่ ราคาสินค้าภายในประเทศ อัตราแลกเปลี่ยน ราคาสินค้าส่งออก GDP ของประเทศคู่ค้า และปริมาณผลผลิต สำหรับปัจจัยที่ส่งผลกระทบต่อมูลค่าการส่งออกผลิตภัณฑ์จากมันสำปะหลัง ได้แก่ ราคาสินค้าภายในประเทศ อัตราแลกเปลี่ยน ราคาสินค้าส่งออก GDP ของประเทศคู่ค้า และปริมาณผลผลิต นอกจากนี้ ปัจจัยที่มีผลต่อมูลค่าการส่งออกกุ้งแช่แข็ง ได้แก่ ราคาสินค้าภายในประเทศ ราคาสินค้าส่งออก GDP ของประเทศคู่ค้า และปริมาณผลผลิต จากผลการศึกษาโดยส่วนมากพบว่า มีความสอดคล้องกับทฤษฎีทางเศรษฐศาสตร์และสามารถนำมาประยุกต์ในการวางแผนนโยบายของหน่วยงานหรือองค์กรที่เกี่ยวข้องต่อไป

Thesis Title Factors Affecting Thailand's Major Agricultural Exports Using Panel Cointegration Method

Author Miss Thitaporn Leelawattanapan

Degree Master of Economics

Thesis Advisory Committee

Dr.Chukiatt Chaiboonsri Advisor

Dr. Anuphak Saosaovaphak Co-advisor

Assoc.Prof.Dr. Prasert Chaitip Co-advisor

ABSTRACT

The main purpose of this research is to study how the interested variables affecting on the values of exports for Thailand's agricultural products. Specifically, the research analyzes the long-term relationship between the dependent variables; which are i) the value importers' Gross Domestic Product (GDP), ii) free on board price, iii) domestic product prices, iv) exchange rate, and v) the quantity of products; toward the independent variables which are the values of export derived from the four main agriculture products that export to five main importing countries. For this research, the four main agricultural products consist of i) rubber, ii) rice, iii) cassava produce, and iv) frozen prawns, whilst the five main importing countries are i) China, ii) Japan, iii) the U.S., iv) Malaysia, and v) South Korea. The data used in this research is annual panel data from 2001 – 2010.

The methods used in this research are: first, Panel Unit Root based on Levin, Lin, and Chu Test (2002), Breitung Test (2001), Im, Pesaran and Shin Test (2003), Fisher-Type Test (1999) (including Fisher-ADF Test and Fisher-PP Test) and Hadri Test (2000). Secondly, Panel Cointegration Test based on Pedroni Residual Cointegration Test is employed in examining variables in the model. Moreover, Huaman Test and Redundant Fixed Effect Test were applied to

choose appropriate test. Finally, General Method of Moment (GMM), Ordinary Least Square (OLS), Dynamic Ordinary Least Square (DOLS) and Fully Modified Ordinary Least Square (FMOLS) are used to estimate the long-run relationship of Thailand's major agricultural export models. For long-run, the results indicate that factors affecting rubber's export values are i) the importer's Gross Domestic Product, ii) the free on board price, iii) the domestic product price, and iv) the quantity of production; for rice's export value, factors affected are i) the importer's Gross Domestic Product, ii) the free on board price, iii) the domestic product price, iv) the exchange rate, and v) the quantity of production. Furthermore, factors affecting product of cassava's export values are i) the importer's Gross Domestic Product, ii) the free on board price, iii) the domestic product price, iv) the exchange rate, and v) the quantity of production. Finally, factors affecting product of frozen shrimp's export values are i) the importer's Gross Domestic Product, ii) the free on board price, iii) the domestic product price, and iv) the quantity of productions. Most of the outcomes in this research are consistent with economic theories and can be applied for policy making.