

ชื่อเรื่องการค้นคว้าแบบอิสระ	การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของภาคการผลิตพืชผลและปริมาณการส่งออกข้าวหอมมะลิของประเทศไทย	
ผู้เขียน	นางสาวประกายเดือน ชรรวมวงศ์	
ปริญญา	เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต	
คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ	ผศ.ดร.ไพรัช กาญจนการุณ	ประธานกรรมการ
	ผศ.ดร.นิสิต พันธมิตร	กรรมการ

บทคัดย่อ

การศึกษานี้มีวัตถุประสงค์ เพื่อศึกษาถึงความสัมพันธ์ระหว่างการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของภาคการผลิตพืชผลและปริมาณการส่งออกข้าวหอมมะลิของประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน โดยใช้ข้อมูลดัชนีผลผลิตพืชผลและปริมาณการส่งออกข้าวหอมมะลิของประเทศไทย ข้อมูลที่ใช้ศึกษาเป็นข้อมูลทุติยภูมิแบบรายเดือนในรูปของลอการิทึม ตั้งแต่ เดือนมกราคม 2545 ถึง เดือนธันวาคม 2551 เป็นจำนวน 84 เดือน

ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูลหรือยูนิทรูท ผลการทดสอบ พบว่า ข้อมูลดัชนีผลผลิตพืชผลและปริมาณการส่งออกข้าวหอมมะลิของประเทศไทย มีความนิ่งของข้อมูลที่อันดับเดียวกันคือ $I(1)$ จึงสามารถนำไปทำการวิเคราะห์ความสัมพันธ์ในระยะยาวและการปรับตัวในระยะสั้นต่อไปได้

ผลการวิเคราะห์ความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพในระยะยาว (Cointegration) พบว่า ทั้งในกรณีปริมาณการส่งออกข้าวหอมมะลิเป็นตัวแปรอิสระและดัชนีผลผลิตพืชผลเป็นตัวแปรตาม และในกรณีดัชนีผลผลิตพืชผลเป็นตัวแปรอิสระและปริมาณการส่งออกข้าวหอมมะลิเป็นตัวแปรตาม ต่างก็มีความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพในระยะยาว หรือกล่าวได้ว่า มีความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพในระยะยาวแบบสองทิศทาง

การทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพในระยะสั้นด้วย Error Correction Mechanism (ECM) พบว่า ทั้งในกรณีปริมาณการส่งออกข้าวหอมมะลิเป็นตัวแปรอิสระและดัชนีผลผลิตพืชผลเป็นตัวแปรตาม และในกรณีดัชนีผลผลิตพืชผลเป็นตัวแปรอิสระและปริมาณการส่งออกข้าวหอมมะลิเป็นตัวแปรตาม ต่างก็มีความสัมพันธ์ซึ่งกันและกันในการปรับตัวในระยะสั้น โดยค่าสัมประสิทธิ์ความคลาดเคลื่อนของทั้งสองกรณีมีค่าเป็นลบ นั่นหมายความว่า มีการปรับตัวในระยะสั้นเข้าสู่ดุลยภาพในระยะยาว

การทดสอบสมมติฐานเชิงเป็นเหตุเป็นผลด้วย Granger Causality Test พบว่า ดัชนีผลผลิตพืชผลเป็นต้นเหตุของปริมาณการส่งออกข้าวหอมมะลิ และปริมาณการส่งออกข้าวหอมมะลิไม่เป็นสาเหตุของดัชนีผลผลิตพืชผล หมายความว่า ความสัมพันธ์ที่เป็นเหตุเป็นผลมีความสัมพันธ์แบบทิศทางเดียว ที่ระดับนัยสำคัญ 0.01

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

Independent Study Title	An Analysis of the Relationship Between Economic Growth of Crop Sector and Export Quantity of Hom Mali Rice of Thailand	
Author	Miss Prakaiduen Thammawong	
Degree	Master of Economics	
Independent Study Advisory Committee	Asst. Prof. Dr. Pairut Kanjanakaroon	Chairperson
	Asst. Prof. Dr. Nisit Panthamit	Member

ABSTRACT

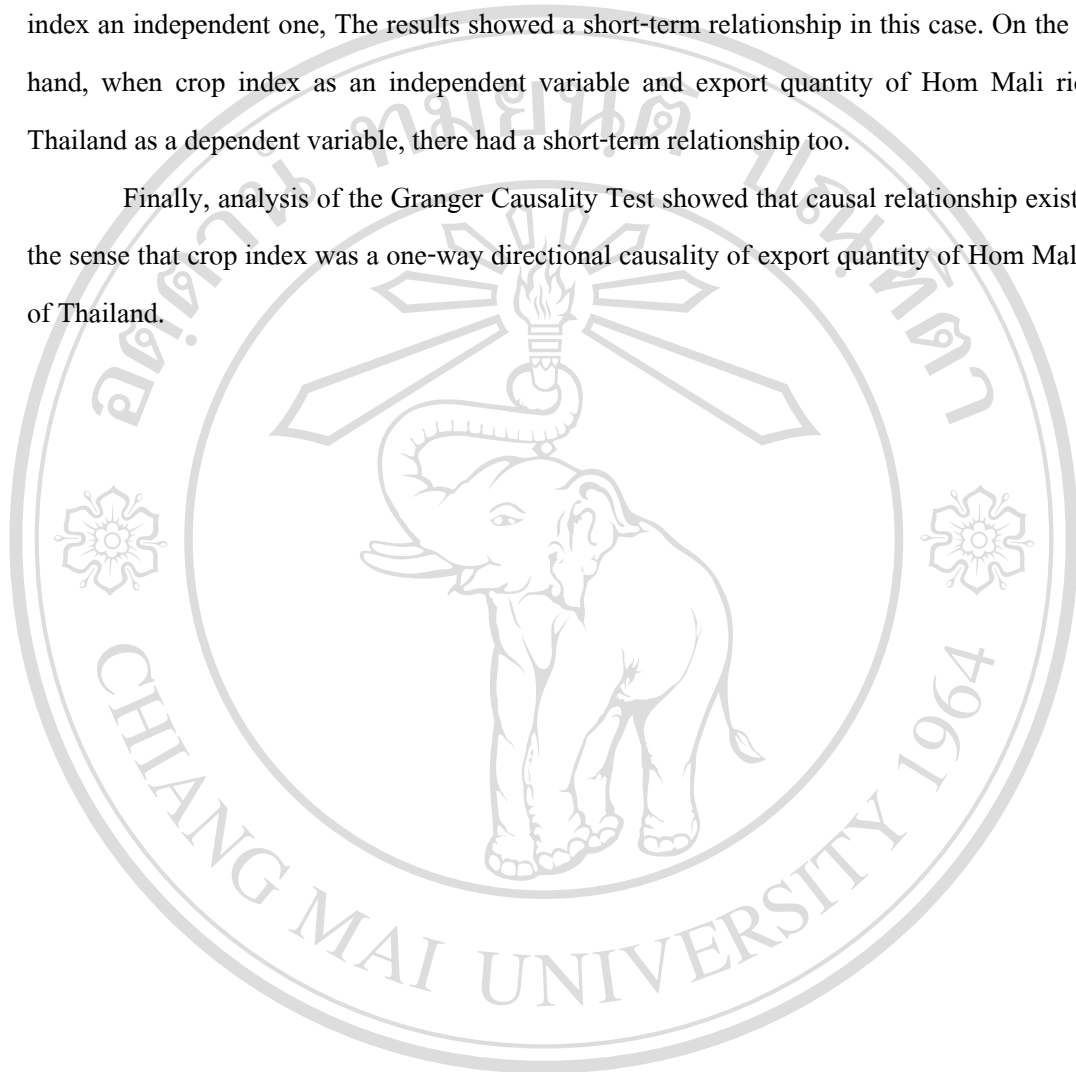
The purpose of this study was to investigate the long and short term relationships between economic growth of crop sector and export quantity of Hom Mali rice of Thailand. Analyzed data were on the monthly closing prices of 84 months starting from January 2002 to December 2008 in logarithm.

Firstly, the Unit Root Test was investigated. The empirical results revealed that in crop index and export quantity of Hom Mali rice of Thailand, There had unit roots with the same orders of integration at an $I(1)$ process. Thus, they could consider short and long term relationships as the next step.

Regarding the Cointegration method in the study of two cases, export quantity of Hom Mali rice of Thailand was a dependent variable and crop index was an independent variable, and vice versa. The results indicated that all residuals were stationary at an $I(0)$ process. Thus, the results showed that crop index and export quantity of Hom Mali rice of Thailand had a long-term relationship in both cases.

According to the analysis of the short-term relationship, using the Error Correction Model when export quantity of Hom Mali rice of Thailand was a dependent variable and crop index an independent one, The results showed a short-term relationship in this case. On the other hand, when crop index as an independent variable and export quantity of Hom Mali rice of Thailand as a dependent variable, there had a short-term relationship too.

Finally, analysis of the Granger Causality Test showed that causal relationship existed in the sense that crop index was a one-way directional causality of export quantity of Hom Mali rice of Thailand.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved