

หัวข้อการค้นคว้าแบบอิสระ	การวิเคราะห์ผลกระทบความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนต่อการส่งออกโดยใช้แบบจำลองปัจจัยการผลิตและผลผลิต	
ผู้เขียน	นายธนทัต สิทธิชัย	
ปริญญา	เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต	
คณะกรรมการที่ปรึกษา	ผศ.ดร.ชูเกียรติ ชัยบุญศรี ดร.จารึก สิงห์ปรีชา	อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

บทคัดย่อ

การค้นคว้าอิสระฉบับนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อวิเคราะห์ถึงผลกระทบของสาขาการผลิตต่างๆ ในระบบเศรษฐกิจของประเทศไทยที่เกิดจากความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนที่ส่งผลกระทบต่อส่งออกของประเทศ โดยจะใช้แบบจำลอง GARCH (general autoregressive conditional heteroskedasticity) ในการหาความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนและการส่งออกซึ่งใช้ข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยนไทยต่อดอลลาร์สหรัฐและข้อมูลการส่งออกของประเทศไทยรายเดือนในช่วงปี พ.ศ. 2548 ถึง พ.ศ.2557 และการใช้แบบจำลองปัจจัยการผลิตและผลผลิต (input-output model) ของปี พ.ศ.2553 โดยทำการรวมสาขาการผลิตตามโครงสร้างสินค้าส่งออกของกรมศุลกากร ในการหาผลกระทบที่เกิดขึ้นของแต่ละสาขาการผลิตเมื่อมีการสมมุติให้ความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนมีความผันผวนในลักษณะที่อ่อนค่าลงจากเดิมร้อยละ 5

ผลการศึกษาพบว่าความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนไทยต่อดอลลาร์สหรัฐส่งผลทำให้มีการขยายตัวของการส่งออกประมาณร้อยละ 1.0314 และเมื่อมีการสมมุติให้อัตราแลกเปลี่ยนมีความผันผวนในลักษณะที่อ่อนค่าลงร้อยละ 5 จะทำให้การส่งออกมีการขยายตัวเพิ่มขึ้นร้อยละ 5.157 และเมื่อนำมาทำการวิเคราะห์ถึงผลกระทบที่เกิดขึ้นของแต่ละสาขาการผลิตพบว่า สาขาการผลิตที่ได้รับผลกระทบมากที่สุด คือ สาขาอุตสาหกรรม โดยได้รับผลกระทบให้มีมูลค่าเพิ่มขึ้นเท่ากับ 931,063,162 บาท และสาขาที่ได้รับผลกระทบน้อยที่สุดคือ สาขาการผลิตอื่นๆ (ธุรกิจกรมพิเศษ) โดยได้รับผลกระทบเพิ่มขึ้นเพียง 2,144,397 บาท

Independent Study Title	An Analysis of the Effect of Fluctuation of Exchange Rate Using on Export by Input-Output Model	
Author	Mr. Tanatat Sittichai	
Degree	Master of Economics	
Advisory Committee	Asst. Prof. Dr. Chukiat Chaibuisri	Advisor
	Dr. Charuk Singhapreecha	Co-advisor

ABSTRACT

This independent study has a purpose to analyze how fluctuation of exchange rate affects manufacturing of Thailand economy via exportation. This research conducts a model applied GARCH (general autoregressive conditional heteroskedasticity) methodology to analyze relation between fluctuation of exchange rate and export from 2005 to 2014. Then input-output model of 2010 is used to find effects of each manufacturing sector which is divided by export structure of customs department, assuming that fluctuation of exchange rate decreases 5 percent.

This study found that fluctuation of exchange rate Bath/USD has positively related to export by approximately 1.0314 (excluding 5 percent assumption) and 5.157 (including 5 percent assumption) percent. When applying those figures into input-output model, it found that the most effected manufacturing sector is industry sector (its value increasing 931,063,162 bath). In contrast, the least effected manufacturing sector is other manufacturing sector (its value increasing only 2,144,397 bath).