

การศึกษาครั้งนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างมูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรทั้งหมดกับการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของประเทศไทย โดยตัวแปรทางเศรษฐกิจที่นำมาพิจารณาในการศึกษา คือ มูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรทั้งหมด และผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ โดยใช้ข้อมูลทุติยภูมิรายไตรมาสครอบคลุมตั้งแต่ พ.ศ. 2540 /ไตรมาส 1 - พ.ศ. 2549/ไตรมาส 4 โดยประยุกต์ใช้เทคนิคทางเศรษฐมิติ ได้แก่ การประยุกต์ใช้เทคนิคโคอินทิเกรชัน (cointegration) เพื่อดูความสัมพันธ์ในระยะยาว เมื่อพบว่าตัวแปรมีความสัมพันธ์ในระยะยาวแล้วจึงนำมาทดสอบแบบจำลองเออเรอร์คอร์เรชัน (error correction mechanism) เพื่อดูการปรับตัวเข้าสู่ดุลยภาพในระยะสั้น สุดท้ายทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล (Granger causality) ว่าตัวแปรใดคือสาเหตุ (cause) และตัวแปรใดคือเหตุผลของสาเหตุนั้น (effects)

จากผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูลทั้งสองตัวแปร คือ มูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรทั้งหมด และข้อมูลผลิตภัณฑ์มวลรวมในประเทศ พบว่าข้อมูลมีลักษณะนิ่ง (stationary) ที่ระดับ order of integration เท่ากับ 1 หรือ $I(1)$ ณ ระดับนัยสำคัญ 0.01 จากนั้นทดสอบความสัมพันธ์กันเชิงดุลยภาพในระยะยาว พบว่ามูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรทั้งหมดและผลิตภัณฑ์มวลรวมในประเทศ ทั้งสองตัวแปรมีความสัมพันธ์ในระยะยาว และสำหรับการประมาณแบบจำลอง error correction model เพื่อทดสอบขบวนการปรับตัวในระยะสั้น พบว่าในกรณีที่มูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรทั้งหมดตัวแปรต้น และผลิตภัณฑ์มวลรวมในประเทศเป็นตัวแปรตามแบบจำลองมีการปรับตัวในระยะสั้น ณ ระดับนัยสำคัญ 0.01 แต่ในกรณีที่ผลิตภัณฑ์มวลรวมในประเทศเป็นตัวแปรต้นและมูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรทั้งหมดเป็นตัวแปรตาม พบว่าแบบจำลองมีการปรับตัวในระยะสั้น ณ ระดับนัยสำคัญ 0.05 ในส่วนของการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผลของมูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรทั้งหมดและผลิตภัณฑ์มวลรวมในประเทศ พบว่าตัวแปรทั้งสองมีความสัมพันธ์กันแบบสองทิศทาง

This study employed econometric procedure to verify the relationship between total agricultural exports value and the economic growth measured by GDP of Thailand. It was based on quarterly secondary data from 1st quarter of 1997 to 4th quarter of 2006. The analytical tools included cointegration technique to ascertain the existence of long-run equilibrium relationship between the two economic variables, error-correction mechanism to understand the short-run adaptation process and the Granger's causality test to identify the cause and effects concerning movements of the two variables.

Testing for unit roots revealed both time series were stationary at $I(1)$ at 0.01 statistically significant level. The result of cointegration regression indicated the existence of long-run equilibrium between total agricultural exports value and GDP. The findings from error-correction model application indicated that there was a short-run adaption of GDP in response to the change in total agricultural exports value at 0.01 statistically significant level, and that a short-run adaptation of total agricultural exports value to the movement of GDP could be established at 0.05 statistically significant level. Furthermore, it was found from the Granger's causality test that there existed a two-way relationship between total agricultural exports value and GDP.