

ชื่อเรื่องการค้นคว้าแบบอิสระ

การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างการนำเข้าและ
ผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศไทย

ผู้เขียน

นายณรงค์ฤทธิ์ สนสร้อย

ปริญญา เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ

รศ.ดร.วินัส ฤาชัย ประธานกรรมการ

อ.ดร.รสริน โอสถานันต์กุล กรรมการ

บทคัดย่อ

การศึกษานี้มีวัตถุประสงค์เพื่อทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการนำเข้าและผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศไทย โดยใช้ข้อมูลทศวรรษรายไตรมาสครอบคลุมตั้งแต่ปี พ.ศ. 2541-พ.ศ.2552 รวมทั้งหมด 48 ไตรมาสของข้อมูล 3 ตัวแปร ได้แก่ มูลค่าการนำเข้าเพื่ออุปโภคบริโภค การนำเข้าวัตถุดิบและสินค้าขั้นกลางและผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ โดยที่การวิเคราะห์ข้อมูลใช้เทคนิคทางเศรษฐมิติ ได้แก่เทคนิคโคอินทิเกรชัน (Cointegration)

ผลการศึกษามีขั้นตอนดังต่อไปนี้ ขั้นแรก ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูลทั้งสามตัวแปรพบว่า ข้อมูลทั้งสามตัวแปรมีลักษณะนิ่ง (Stationary) ที่ระดับความแตกต่างลำดับที่ 1 (first difference) ณ ระดับนัยสำคัญ 0.05 ขั้นที่สอง ผลการทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพในระยะยาวพบว่า การนำเข้าเพื่ออุปโภคบริโภคมีความสัมพันธ์ในระยะยาวกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ เช่นเดียวกัน การนำเข้าวัตถุดิบและสินค้าขั้นกลางก็มีความสัมพันธ์ในระยะยาวกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ ขั้นที่สาม ผลการทดสอบ Error Correction Mechanism ซึ่งเป็นขบวนการปรับตัวในระยะสั้น ณ ระดับนัยสำคัญ 0.05 พบว่าทั้งสามตัวแปรมีการปรับตัวในระยะสั้นเข้าสู่ดุลยภาพในระยะยาว และในขั้นตอนสุดท้าย ผลการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล (Granger Causality) พบว่า การนำเข้าเพื่ออุปโภคบริโภคมีความสัมพันธ์แบบสองทิศทางกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ เช่นเดียวกัน การนำเข้าวัตถุดิบและสินค้าขั้นกลางก็มีความสัมพันธ์แบบสองทิศทางกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ

Independent Study Title	Analysis of the Relationship Between Import and GDP of Thailand	
Author	Mr.Narongrit Sonsroi	
Degree	Master of Economics	
Independent Study Advisory Committee	Assoc.Prof.Dr.Venus Rauechai	Chairperson
	Lect.Dr.Rossarin Osathanukul	Member

ABSTRACT

The objective of this study was to examine a relationship between import and GDP of Thailand by using the secondary data gathered quarterly, covering from 1998 to 2009, or the total of 48 quarters. The three variables in the study were consumer product import value, raw material and semi-finished product import value, and GDP. An econometric technique used for analysis was cointegration.

The results of the study were divided into four steps. Firstly, the stationarity test found that the three variables were stationary with the first difference at the significance level of 0.05. Secondly, the cointegration test indicated that consumer product import had a long-term relationship with the GDP, which was similar to a relationship between raw material and semi-finished product import and the GDP. Thirdly, the Error Correction Mechanism test, a short-term adaptation process test at the significance level of 0.05, showed that those variables had a short-term adaptation towards a long-run equilibrium. Lastly, the results of the Granger Causality test showed that the consumer product import had a two-way relationship with the GDP, which was similar to a relationship between raw material and semi-finished product import and the GDP.