234251

การศึกษาครั้งนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการบริโภคของภาคเอกชนกับการผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศไทย โดยใช้ข้อมูลทุติยภูมิชนิดอนุกรมเวลารายไตรมาสตั้งแต่ปี พ.ศ. 2541 ถึงปี พ.ศ. 2552 รวมทั้งสิ้น 12 ปี มีทั้งหมด 48 ไตรมาส ซึ่งตัวแปรที่นำมาศึกษา ได้แก่ การบริโภคของภาคเอกชนในส่วนของสินค้า การบริโภคของภาคเอกชนในส่วนของบริการ และผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศไทย โดยใช้เทคนิคทางเศรษฐมิติ ได้แก่วิธี Cointegration , Error Correction Mechanism และ Granger Causality เพื่อหาทิศทางความสัมพันธ์ระหว่างตัวแปร

ผลการศึกษามีขั้นตอนดังต่อไปนี้ ขั้นแรกการทดสอบความนิ่งของข้อมูลทั้งสามตัวแปร พบว่าตัวแปรทุกตัวมี Order of Integration เดียวกัน คือ I(1) ณ ระดับนัยสำคัญที่ 0.01 ขั้นที่สองทดสอบความสัมพันธ์ระยะยาวของการบริโภคของภาคเอกชนในส่วนของสินค้ากับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศและการบริโภคของภาคเอกชนในส่วนของบริการกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ พบว่ามีความสัมพันธ์ในระยะยาว ขั้นที่สามทดสอบการปรับตัวในระยะสั้น พบว่ากรณีที่ผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศเป็นตัวแปรอิสระและการบริโภคของภาคเอกชนในส่วนของสินค้าเป็นตัวแปรตามแบบจำลองไม่มีการปรับตัวในระยะสั้น แต่ในกรณีที่การบริโภคของภาคเอกชนในส่วนของสินค้าเป็นตัวแปรอิสระและผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศเป็นตัวแปรตาม กรณีที่ผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศเป็นตัวแปรอิสระและการบริโภคของภาคเอกชนในส่วนของบริการเป็นตัวแปรตามและกรณีที่การบริโภคของภาคเอกชนในส่วนของบริการเป็นตัวแปรอิสระและผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ ทั้ง 3 กรณี แบบจำลองมีการปรับตัวในระยะสั้น และในขั้นตอนสุดท้ายการทดสอบความสัมพันธ์ที่เป็นเหตุเป็นผลระหว่างการบริโภคของภาคเอกชนในส่วนของสินค้ากับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศและการบริโภคของภาคเอกชนในส่วนของบริการกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศพบว่ามีความสัมพันธ์แบบสองทิศทาง

234251

This study tested the relationship between private consumption and Gross Domestic product-GDP of Thailand based on secondary quarterly time series data during 1998-2009, covering 48 observations in this 12 years period. The private consumption variables involved consumption of goods and services by private sector while GDP was the country's official statistics. Various time series econometrics techniques were employed for the analysis including Cointegration approach, Error Correction Mechanism, and Granger Causality test to establish the relationship between variables.

The whole study was divided into four stages. The first was testing for unit roots and the results indicated all three sets of time series were stationary and had the same order of integration namely I (1) at 0.01 statistically significant level. The second stage dealt with testing for long term relationship between consumption of goods by private sectors and GDP, and that between consumption of services by private sector and GDP with the results suggesting there was cointegration or long term relationship between the pair of relevant variables. The third stage concerned testing for short run adjustment process. It was found no short run adjustment took place in the model treating GDP as independent variable and private consumption of goods as dependent while short run adjustment process existed in the cases of private consumption of goods as independent and GDP as dependent variable GDP as independent and private consumption of services as dependent variable, as well as private consumption of services as independent and GDP as dependent variable. Finally, the Granger Causality test was performed which yielded the finding that the causal relationship was two-way between private consumption of goods and GDP as well as between private consumption of services and GDP.