

ชื่อเรื่องการค้าค้นคว้าแบบอิสระ

การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างดุลสินค้าและบริการกับอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศกำลังพัฒนา

ผู้เขียน

นางสาวรุจิรา กุศลเลิศจริยา

ปริญญา

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้าค้นคว้าแบบอิสระ

ผศ.ดร. นิสิต พันธมิตร

ประธานกรรมการ

รศ.ดร. ธเนศ ศรีวิชัยลำพันธ์

กรรมการ

บทคัดย่อ

การศึกษานี้มีจุดประสงค์เพื่อมุ่งทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างดุลสินค้าและบริการกับอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศกำลังพัฒนา 8 ประเทศ ได้แก่ ประเทศฟิลิปปินส์ ประเทศไทย ประเทศอินโดนีเซีย ประเทศบราซิล ประเทศเม็กซิโก ประเทศแอฟริกาใต้ ประเทศรัสเซีย และประเทศอินเดีย โดยทำการทดสอบด้วยวิธี Cointegration และ Error Correction Model (ECM) ตามกระบวนการ Autoregressive Distributed Lag (ARDL) และใช้ข้อมูลรายไตรมาสเริ่มตั้งแต่ปี 1998 ไตรมาสที่ 1 ถึงปี 2007 ไตรมาสที่ 4 จำนวนทั้งสิ้น 40 ไตรมาส

จากการศึกษาการปรับตัวในระยะสั้นเข้าสู่ดุลยภาพในระยะยาว พบว่าประเทศที่มีความสัมพันธ์ระหว่างดุลสินค้าและบริการกับอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริง ได้แก่ ประเทศฟิลิปปินส์ ประเทศไทย ประเทศอินโดนีเซีย และประเทศรัสเซีย ส่วนการวิเคราะห์ความสัมพันธ์ในระยะยาว พบว่า ประเทศที่มีดุลสินค้าและบริการกับอัตราแลกเปลี่ยนมีความสัมพันธ์ในทิศทางเดียวกันได้แก่ ประเทศไทย ประเทศอินโดนีเซีย ประเทศบราซิล ประเทศเม็กซิโก ประเทศแอฟริกาใต้ ประเทศรัสเซีย และประเทศอินเดีย

Independent Study Title A Test of the Relationship Between Trade Balance And Exchange Rate of Developing Countries

Author Miss Rujira Kusalertjariya

Degree Master of Economics

Independent Study Advisory Committee

Asst. Prof. Dr. Nisit Panthamit Chairperson

Assoc. Prof. Dr. Thanet Sriwichailamphan Member

ABSTRACT

The objective of this study is to test the relation between trade balance and the real exchange rate of developing countries in Philippine, Thai, Indonesia, Brazil, Mexico, South Africa, Russia and India. The study is conducted by analyzing the cointegration and error correction in ARDL model, using secondary data from the first quarter of 1998 to the last quarter of 2007, totally 40 observations.

The empirical results show that in the short run, real exchange rate and trade balance variables have a correlation in Philippine, Thailand, Indonesia and Russia. Moreover, in the long run, the studies also find the relationship between real exchange rate and trade balance, carrying positive correlation in Thailand, Indonesia, Brazil, Mexico, South Africa, Russia, and India.

ลิขสิทธิ์ © by Chiang Mai University
All rights reserved