

บทคัดย่อ

การศึกษานี้ทำการวิเคราะห์ ปัจจัยกำหนดวัฏจักรของอัตราเจริญเติบโตของการส่งออกสินค้าหลักของประเทศไทย ด้วยแบบจำลองสลับสับเปลี่ยนมาร์คอฟ โดยการศึกษาใช้ข้อมูลรายไตรมาสตั้งแต่ไตรมาสที่ 1 ปี 2543 ถึง ไตรมาสที่ 4 ปี 2555 ของการส่งออกสินค้า 23 ชนิดของประเทศไทย แต่สำหรับการส่งออกสินค้า 6 ชนิด ได้แก่ ข้าว ยาง มันสำปะหลัง ผลไม้ ผลิตภัณฑ์จากสัตว์ และประมง ใช้ข้อมูลรายไตรมาสตั้งแต่ไตรมาสที่ 1 ปี 2548 ถึง ไตรมาสที่ 4 ปี 2555 ผลการศึกษาพบว่ามีเพียงการส่งออกสินค้า 5 ชนิด คือ ข้าว ยาง มันสำปะหลัง ผลไม้ และผลิตภัณฑ์จากสัตว์เท่านั้นที่มีค่าสถิติ โดยพบว่า อัตราการเจริญเติบโตของการส่งออกข้าวมีสถานการณ์ตกต่ำเป็นเวลานานมาก อัตราการเจริญเติบโตของการส่งออกยางและมันสำปะหลังมีสถานการณ์ขยายตัวเป็นเวลานานแต่สถานการณ์ตกต่ำมีระยะสั้น ส่วนอัตราการเจริญเติบโตของการส่งออกผลไม้และผลิตภัณฑ์จากสัตว์มีการสลับกันระหว่างสถานการณ์ขยายตัวและตกต่ำ โดยมีระยะเวลาเท่ากันในทั้งสถานการณ์ขยายตัวและตกต่ำ ซึ่งอัตราการเจริญเติบโตของอัตราแลกเปลี่ยนมีผลต่ออัตราการเจริญเติบโตของการส่งออกข้าว และยาง อัตราการเจริญเติบโตของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศผู้นำเข้ามีผลต่ออัตราการเจริญเติบโตของการส่งออกข้าว ยาง และมันสำปะหลัง อัตราการเจริญเติบโตของดัชนีราคาส่งออกมีผลต่ออัตราการเจริญเติบโตของการส่งออกข้าว ยาง มันสำปะหลัง ผลไม้ และผลิตภัณฑ์จากสัตว์ นอกจากนั้น อัตราการเจริญเติบโตของดัชนีอุตสาหกรรมมีผลต่ออัตราการเจริญเติบโตของการส่งออกข้าว ยาง และมันสำปะหลัง

Abstract

This study analyzes factor affecting cycles of exports growth rate of major goods of Thailand using a Markov Regime-switching model. This study use quarterly data from 2000 quarter 1 to 2012 quarter 4 of 23 export goods of Thailand. For 6 export goods i.e. rice, rubber, tapioca, fruits, animal products, and fishery use quarterly data from 2005 quarter 1 to 2012 quarter 4. The findings of this study show that only 5 export goods i.e. rice, rubber, tapioca, fruits and animal products have statistics. The growth of export rice has very long term recession regime. The growths of export rubber and tapioca have long term expansion regime and short term recession regime. The growths of export fruits and animal products have switching between expansion regime and recession regime and they have equal duration of expansion regime and recession regime. The growth of exchange rate affect to growth of export rice, and rubber. The growth of importer GDP affect to growth of export rice, rubber, and tapioca. The growth of export price index affect to growth of export rice, rubber, tapioca, fruits, and animal products. Moreover, the growth of industry index affect to growth of export rice, rubber, and tapioca.