

ชื่อเรื่องวิทยานิพนธ์

ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราเงินเฟ้อและอัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้

ผู้เขียน

นางสาวกัทชนาฏ เรืองแสง

ปริญญา

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์

อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์กุล

อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก

อ.ดร.กัญสุดา นิ่มอนุสรณ์กุล

อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

อ.ดร.อนันต์ปรีชญ์ ไชยวรรณ

อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

บทคัดย่อ

การศึกษานี้มีวัตถุประสงค์เพื่อศึกษาความสัมพันธ์ระหว่างอัตราเงินเฟ้อและอัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้โดยใช้ข้อมูลทศนิยมรายไตรมาสและรายปี โดยข้อมูลรายไตรมาสจะใช้ตั้งแต่ไตรมาสที่ 2 ปี พ.ศ.2540 ถึงไตรมาสที่ 4 ปี พ.ศ.2554 และข้อมูลรายปีจะใช้ตั้งแต่ปี พ.ศ.2511 ถึง ปี พ.ศ.2553 ซึ่งใช้วิธีการวิเคราะห์ข้อมูลแบบพหุคูณได้แก่ การทดสอบพหุคูณนิทรุต การทดสอบความเป็นเหตุเป็นผลแบบแกรงเกอร์การทดสอบสมการพหุคูณ และการประมาณแบบจำลองพหุคูณ

ผลการทดสอบพหุคูณนิทรุตเพื่อทดสอบความนิ่งของข้อมูล พบว่าอัตราเงินเฟ้อและอัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจ มีลักษณะนิ่งที่ระดับ level หรือ $I(0)$ ดังนั้นจึงนำตัวแปรมาสร้างแบบจำลองเพื่อทดสอบหาความสัมพันธ์เชิงเป็นเหตุและเป็นผลระหว่างอัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจและอัตราเงินเฟ้อ โดยผลการศึกษาแบ่งออกเป็นรายไตรมาสและรายปี

ผลการศึกษารายไตรมาสพบว่า อัตราเงินเฟ้อไม่เป็นต้นเหตุของอัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจ แต่อัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจเป็นต้นเหตุของอัตราเงินเฟ้อ ดังนั้นจึงสรุปได้ว่าความสัมพันธ์ที่เป็นเหตุเป็นผลระหว่างอัตราเงินเฟ้อกับอัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจเป็นความสัมพันธ์แบบทิศทางเดียว และผลจากการประมาณค่าพบว่า อัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจมีผลต่ออัตราเงินเฟ้อในทิศทางตรงกันข้าม

ผลการศึกษารายปีพบว่า อัตราเงินเฟ้อเป็นต้นเหตุของอัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจ และอัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจก็เป็นต้นเหตุของภาวะเงินเฟ้อ ดังนั้นจึงสรุปได้ว่าการทดสอบความสัมพันธ์ที่เป็นเหตุเป็นผลระหว่างอัตราเงินเฟ้อกับอัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจ มีความสัมพันธ์แบบสองทิศทาง ผลจากการประมาณค่าพบว่าอัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจมีผลต่ออัตราเงินเฟ้อในทิศทางเดียวกัน และอัตราเงินเฟ้อก็มีผลต่ออัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจในทิศทางเดียวกัน

Thesis Title Relationship Between Inflation Rate and Economic Growth Rate of South-East Asian Countries

Author Ms. Patchnart Rouangsang

Degree Master of Economics

Thesis Advisory Committee

Lect. Dr. Chaiwat Nimanusornkul

Advisor

Lect. Dr. Kunsuda Nimanusornkul

Co-advisor

Lect. Dr. Anaspree Chaiwan

Co-advisor

ABSTRACT

This study has the objective to examine the relationship between inflation rate and economic growth rate in south-east Asian countries using quarterly and yearly secondary data. Quarterly data was analyzed from the second quarter of 1997 to the fourth of 2011. Yearly data from 1968-2010. The tools for the analysis of panel data included panel unit roots test, panel Granger causality test, panel equation test and estimation panel model. The results of panel unit roots test for stationary of the time series indicated that inflation rate and economic growth rate are stationary at level $I(0)$. Therefore, the variables are modeled to determine the Granger causality between economic growth rate and inflation rate. The study was divided into quarterly and yearly data. The results of quarterly data show indirect causality between inflation rate and economic growth rate. however, direct causality exists between economic growth rate and inflation rate. Therefore, the relationship between inflation rate and economic growth rate is one-directional. And, The result of estimation panel model shows economic growth rate varied inversely with inflation rate. The results of yearly data show direct causality between inflation rate and the economic growth rate and vice versa. Therefore, the relationship between inflation rate and economic growth rate is bi-directional. And, The result of estimation panel model shows

economic growth rate varied in the same direction as inflation rate and inflation varied in the same direction as economic growth rate.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

