

ชื่อเรื่องวิทยานิพนธ์

ความสัมพันธ์ระหว่างราคาน้ำมันกับปริมาณ
การส่งออกสินค้าทางอากาศของประเทศไทย
โดยใช้วิธีเทสโฮลด์โคอินทิเกรชัน

ผู้เขียน

นางสาวนันทวรรณ พานิชย์จิระสกุล

ปริญญา

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์

อ.ดร.ชูเกียรติ ชัยบุญศรี

อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก

อ.ดร.อนุภาค เสาร์เสาวภาคย์

อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

บทคัดย่อ

ในการวิจัยเรื่อง ความสัมพันธ์ระหว่างราคาน้ำมันกับปริมาณการส่งออกสินค้าทางอากาศของประเทศไทย มีวัตถุประสงค์เพื่อวิเคราะห์ความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาวระหว่างราคาน้ำมันโลก ราคาน้ำมันของเครื่องบิน และปริมาณการส่งออกสินค้าทางอากาศของประเทศไทยไปสู่ประเทศคู่ค้าที่สำคัญซึ่งได้แก่ ประเทศสหรัฐอเมริกา ประเทศเยอรมัน และสาธารณรัฐประชาชนจีน และเพื่อเปรียบเทียบระหว่างแบบจำลอง Traditional Cointegration กับแบบจำลอง Threshold Cointegration ในการวิเคราะห์ความสัมพันธ์ โดยในการศึกษาจะใช้ข้อมูลทุติยภูมิรายเดือน ตั้งแต่เดือนมกราคม ปี พ.ศ. 2543 ถึง เดือนกันยายน พ.ศ. 2554 จากการศึกษาพบว่า ทั้งสามประเทศมีความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาวระหว่างราคาน้ำมันโลก ราคาน้ำมันของเครื่องบินและปริมาณการส่งออกสินค้าทางอากาศทั้งในส่วนของแบบจำลอง Tradition Cointegration และแบบจำลอง Threshold Cointegration ซึ่งเมื่อทำการเปรียบเทียบทั้งสองแบบจำลอง พบว่า ในแบบจำลอง Threshold Cointegration ราคาน้ำมันโลก และราคาน้ำมันเครื่องบินสามารถอธิบายปริมาณการส่งออกสินค้าทางอากาศได้มากกว่าแบบจำลอง Traditional Cointegration เนื่องจากค่า Adjusted R-squared ของแบบจำลอง Threshold Error Correction Model มีค่ามากกว่าของแบบจำลอง Error Correction Model

Thesis Title The Relationship Between Oil Price and Air Cargo
Exports from Thailand Using Threshold Cointegration

Author Miss Nonthawan Panichjirasakul

Degree Master of Economics

Thesis Advisory Committee

Dr. Chukiatt Chaiboonsri Advisor

Dr. Anuphak Saosaovaphak Co-advisor

ABSTRACT

The purpose of this study is to analyze the relationship between jet fuel prices, crude oil prices and air cargo exports from Thailand to the US, Germany and the People's Republic of China, and to compare the model between Traditional Cointegration and Threshold Cointegration so as to analyze the relationship of these three variables. The data used in this study is secondary data taken from monthly statistics from January 2000 to September 2011. The study finds that all countries have the long-run equilibrium relationship between jet fuel price, crude oil price and air cargo exports by using Traditional Cointegration and Threshold Cointegration. In addition, this empirical study of comparing between the two models by using Goodness of Fit or Adjusted R-squared finds that jet fuel prices and crude oil prices in Threshold Cointegration model can explain air cargo exports more than Traditional Cointegration. The evidence finds that the Adjusted R-squared of Threshold Error Correction Model is higher than the Adjusted R-squared of Error Correction Model.