

หัวข้อการค้นคว้าแบบอิสระ การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างรายจ่ายรัฐบาล และผลิตภัณฑ์มวลรวมของประเทศไทยรายสาขา

ผู้เขียน นายวุฒิชัยพงษ์ ตาเบา

ปริญญา เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษา อ.ดร.รสริน โอสถำนันต์กุล อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก
ผศ.ดร.กัญญ์สุดา นิ่มอนุสรณ์กุล อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

บทคัดย่อ

การศึกษาในครั้งนี้เป็นการศึกษาถึงความสัมพันธ์ระหว่างรายจ่ายรัฐบาล และผลิตภัณฑ์มวลรวมของประเทศไทยรายสาขา โดยการศึกษาได้ใช้ข้อมูลทศนิยมรายไตรมาส ตั้งแต่ไตรมาส 1 ปี พ.ศ. 2541 ถึง ไตรมาสที่ 4 ปี พ.ศ. 2557 ซึ่งประกอบด้วย รายจ่ายประจำของรัฐบาล รายจ่ายเพื่อการลงทุนของรัฐบาล ผลิตภัณฑ์มวลรวมภาคเกษตร ผลิตภัณฑ์มวลรวมภาคอุตสาหกรรม และผลิตภัณฑ์มวลรวมภาคบริการ การทดสอบความนิ่งของข้อมูลพบว่าข้อมูลทุกตัวมีลักษณะหนึ่งที่ I(1) การพิจารณาความล่าช้าหรือ Lag ที่ใช้ในการประมาณค่าพบว่าค่า lag ที่เหมาะสมที่ระดับ 8 Lag

ผลการวิเคราะห์แบบจำลอง Cointegration แต่เนื่องจาก full rank จึงทำให้กลายเป็นแบบจำลอง VAR และที่ระดับความเชื่อมั่นร้อยละ 95 พบว่า มูลค่าผลิตภัณฑ์ภาคเกษตร มูลค่าผลิตภัณฑ์ภาคอุตสาหกรรม และมูลค่าผลิตภัณฑ์ภาคบริการในไตรมาสปัจจุบัน ไม่ได้มีผลมาจากรายจ่ายภาครัฐบาลทั้งในด้านรายจ่ายประจำและรายจ่ายเพื่อการลงทุนของภาครัฐ แต่ในขณะเดียวกัน รายจ่ายประจำและรายจ่ายเพื่อการลงทุนของภาครัฐกลับเปลี่ยนแปลงไปตามมูลค่าผลิตภัณฑ์มวลรวมแต่ละภาคการผลิตในไตรมาสก่อนหน้าเป็นหลัก

จากการวิเคราะห์ความเป็นเหตุเป็นผลตามวิธีของ Granger Causality พบว่าทิศทางความสัมพันธ์เป็นไปในลักษณะที่ว่ามูลค่าผลิตภัณฑ์ภาคอุตสาหกรรม และภาคบริการเป็นเหตุให้เกิดการเปลี่ยนแปลงในรายจ่ายประจำภาครัฐบาล และมูลค่าผลิตภัณฑ์ภาคเกษตร มูลค่าผลิตภัณฑ์ภาคอุตสาหกรรม และภาคบริการเป็นเหตุให้เกิดการเปลี่ยนแปลงในรายจ่ายเพื่อการลงทุนของภาครัฐบาล

Independent Study Title Analysis of the Relationship Between Thailand's
Government Expenditure and Gross Domestic Product
by Sector

Author Mr.Wutthipong Tabao

Degree Master of Economics

Advisory Committee Lect.Dr.Rossarin Osathanunkul Advisor
Asst.Prof.Dr.Kunsuda Nimanussornkul Co-advisor

ABSTRACT

This study was to investigate the relationship between government expenditure and GDP of the sector. This study used secondary data quarterly, since the first quarter of 1998 to the fourth quarter of 2015, consisting of current government expenditure, investment government expenditure, gross agricultural sector, gross industrial sector, and gross services sectors. The unit root test is in the first order of integration or I(1). The optimal lag length or lag estimated the lag right in the eighth lag.

The analysis of cointegration models was at full rank. Therefore, the analysis of cointegration models became VAR models, significant at confidence level of ninety-five percent. These results show that the value of agricultural product industrial product and services products in the current quarter were not a result of government spending in both current expenditure and investment expenditure. At the same time, current expenditure and investment expenditure were a result of the gross domestic product in the manufacturing sector in the previous quarter.

Analysis of the Granger Causality method found that the industrial and service sectors have caused a change in current government expenditure and the value of agricultural, industrial, and services sectors caused the change in expenditure for investments by the government.