

เอกสารประกอบการประชุมวิชาการนเรศวรวิจัย ครั้งที่ 9



9

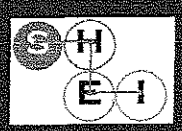
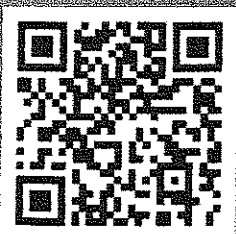
ความรู้สู่เชิงพาณิชย์ นำเศรษฐกิจไทยก้าวไกลอาเซียน

Research-Based Commercialization
for ASEAN Economic Development

ABSTRACTS

28 - 29 กรกฎาคม 2556

ณ อาคารเฉลิมพระเกียรติ 72 พรรษา มหาวิทยาลัยนเรศวร



9 กลุ่มเศรษฐศาสตร์

1	โครงสร้างตลาดและพฤติกรรมตลาดของอุตสาหกรรมกาแฟสำเร็จรูปในประเทศไทย ฐานันต์ อานนท์กิจพานิช	103
2	กระบวนการโลจิสติกส์ของผลิตภัณฑ์กะหล่ำมะพร้าวใน อำเภออัมพวาจังหวัดสมุทรสงคราม วรรณีย์ สุทธิใจดี	104
3	กระบวนการมีส่วนร่วมในการดำเนินการของสหกรณ์ออมทรัพย์จำกัด ในจังหวัดสุราษฎร์ธานี ศิริวันนิภา รัตนจินดา	105
4	การวิเคราะห์การตอบสนองของอุปทานผลผลิตข้าวของจังหวัดในเขตภาคเหนือตอนล่าง มาฆะสิริ เขาวกุล และจิรายุ ภาษาเกียรติกุล	106
5	การพัฒนาต้นแบบการบริหารร้านค้าชุมชนแบบการขยายตรงของร้านค้าชุมชน ตำบลเขาทอง อ.พยุหะคีรี จ.นครสวรรค์ สมพร พูลพงษ์	107
6	การวัดประสิทธิภาพของอุปทานการท่องเที่ยวของประเทมาเลเซีย ประเทศไทย และประเทศสิงคโปร์ ปราชญ์ อนุมติ และอนุภาค เสาร์เสาวภาคย์	108
7	การวางแผนทางการเงินส่วนบุคคล กรณีศึกษา นักศึกษาวิทยาลัยอินเตอร์เทคลำปาง จังหวัดลำปาง ทวยาทอง เลิศเบียง	109
8	การศึกษาความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาอสังหาริมทรัพย์และปัจจัยทางเศรษฐกิจ ตั้งแต่ปี พ.ศ.2535 ถึงปี พ.ศ.2555 อนงค์นาถ ชื่นจิตต์, อนัสปรีย์ ไชยวรรณ, ชัยวัฒน์ นิมอนุสรณ์กุล, กัญญ์สุตา นิมอนุสรณ์กุล	110
9	การสร้างแบบจำลองการพยากรณ์อัตราแลกเปลี่ยนของกลุ่มประเทศในอาเซียน ศุภศิวิ สุวรรณเกษร	111
10	คุณค่าแบรนด์จากการรับรู้ภาพลักษณ์และบุคลิกภาพของจุดหมายปลายทางการท่องเที่ยวภายในประเทศ จากนักท่องเที่ยวชาวไทย กฤษณ์ทิพย์ แสนทวี	112
11	ปัจจัยที่กำหนดการลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศในอุตสาหกรรมการผลิตของประเทศไทย วงศ์พร บุตรดา, อนัสปรีย์ ไชยวรรณ, ชัยวัฒน์ นิมอนุสรณ์กุล, และกัญญ์สุตา นิมอนุสรณ์กุล	113
12	พฤติกรรมและความตั้งใจที่จะใช้บริการเว็บไซต์ของสำนักงานอัยการพิเศษฝ่ายคุ้มครองสิทธิประชาชน ระหว่างประเทศ (สฟคป.) ศิริรนา บัณฑุ	114
13	วิเคราะห์ปัจจัยที่ส่งผลต่อโอกาสในการปรับตัวของผู้ประกอบการ SMEs จากนโยบาย ค่าแรงขั้นต่ำ 300 บาท ในภาคการผลิตของจังหวัดเชียงใหม่ ภาณุพนธ์ เข้มทิศ	115

10 กลุ่มสังคมวิทยา

1	แนวทางการดำรงชีวิตอย่างมีสุขตามหลักปรัชญาเศรษฐกิจพอเพียงของประชาชนในชุมชนเมือง เขตดุสิต กรุงเทพมหานคร ภูสิทธิ์ ชันติกุล	119
2	การปฏิบัติตามข้อกำหนดในมาตรฐานการสอบบัญชีรหัส 700 การแสดงความเห็นและการรายงาน ต่อการเงินของผู้สอบบัญชีรับอนุญาต ณัฐพร ลีลาโส	120

การสร้างแบบจำลองการพยากรณ์อัตราแลกเปลี่ยนของกลุ่มประเทศในอาเซียน

ศุภศิรั สุวรรณเกษร

The Creating of Forecasting Model of Exchange Rate in ASEAN Countries

Supsi Suwankesorn

อาจารย์ประจำภาควิชาเศรษฐศาสตร์ธุรกิจ คณะวิทยาการจัดการ มหาวิทยาลัยราชภัฏพิบูลสงคราม

Lecturer, the Department of Business Economics, Faculty of Management Science, Pibulsongkram Rajabhat University

เบอร์ติดต่อ 0-5526-7103 E-mail : Supsi@hotmail.com

บทคัดย่อ

การศึกษานี้มีวัตถุประสงค์เพื่อพัฒนาแบบจำลองการพยากรณ์อัตราแลกเปลี่ยนของประเทศในกลุ่มอาเซียนทั้ง 10 ประเทศ ได้แก่ ไต้หวัน ดอลลาร์บรูไน เรียลกัมพูชา รูเปียห์อินโดนีเซีย กีบลาว เปโซฟิลิปปินส์ ริงกิตมาเลเซีย จ๊าตพม่า ดอลลาร์สิงคโปร์ บาทไทย และเงินด่งเวียดนาม ผลการศึกษาค้นพบว่าคุณสมบัติความนิ่งของข้อมูลด้วยวิธี Augmented Dickey-Fuller พบว่า ตัวแปร BRU IDN SGP และ THA มีความนิ่งของข้อมูลในระดับ Level และมีความล่าช้า (Lags) ที่ 12 10 12 และ 12 ตามลำดับ ตัวแปร KHM LAO PHL MYR MYS และ VNM มีความนิ่งของข้อมูลในระดับ First Difference และมีความล่าช้า (Lags) ที่ 11 11 12 3 8 และ 10 ตามลำดับ ในขั้นตอนของการหาความล่าช้า (Lag Length) ที่เหมาะสม ผลการศึกษาพบว่าแบบจำลองมีค่า AIC HQC และ SC ต่ำที่สุดที่ค่าความล่าช้าเท่ากับ 1 และผลการวิเคราะห์ด้วยแบบจำลองเวกเตอร์ออโตรีเกรสชัน (VAR) พบว่า อัตราแลกเปลี่ยนสกุลดอลลาร์บรูไน และดอลลาร์สิงคโปร์ ณ $t-1$ มีความสัมพันธ์กับอัตราแลกเปลี่ยนเงินสกุลอื่นของประเทศในอาเซียนมากที่สุด จำนวน 4 ประเทศ รองลงมา คือ ริงกิตมาเลเซีย (3 ประเทศ) รูเปียห์อินโดนีเซีย (2 ประเทศ) เปโซฟิลิปปินส์ (2 ประเทศ) และจ๊าตพม่า (2 ประเทศ) ตามลำดับ

คำสำคัญ: อาเซียน แบบจำลองเวกเตอร์ออโตรีเกรสชัน

Abstract

The Purpose of this study is to develop a model to forecast the exchange rate of the the 10 ASEAN countries including Brunei Dollar, Cambodian Riel, Indonesian Rupiah, Philippine Peso, Lao kip, Malaysian Ringgit, Myanmar Kyat, Singapore Dollar, THB Thailand and the Vietnamese dong. The result for the stability of the time series data with the Augmented Dickey-Fuller, the variables BRU IDN SGP and THA are stationary at Level and the Lags at 12, 10, 12 and 12 respectively, variable KHM LAO PHL MYR. MYS and VNM are stationary at the First Difference and the lags 11 11 12 3 8 and 10, respectively, in the process of finding of Lag Length the results showed that the model has the lowest score of AIC HQC and SC at one lag, and the results of the analysis with Vector Autoregression Model (VAR) showed that Brunei Dollar currency exchange rate. And the Singapore dollar at the time $t-1$ is correlated with the exchange rate of the country in ASEAN (4 countries) the second is Ringgit Malaysia (3 countries) Indonesian Rupiah (2 countries) Philippine Peso (2 countries) and Kyat Myanmar (2 countries), respectively.

Keywords: ASEAN, Vector Autoregression Model