



การประชุมวิชาการ

โครงการ รู้จักอาเซียน
วันที่ 28 - 30 มีนาคม พ.ศ. 2556

ณ อาคารบัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยราชภัฏพระนครศรีอยุธยา

จัดโดย....สถาบันวิจัยและพัฒนา
มหาวิทยาลัยราชภัฏพระนครศรีอยุธยา

สารบัญ

หน้า

ส่วนที่ 1 บทความจากผู้ทรงคุณวุฒิ	
ไม่ยากตกงาน ต้องพร้อมสู่ “ประชาคมอาเซียน”	1
ศ.ดร.เกรียงศักดิ์ เจริญวงศ์ศักดิ์	
การเตรียมความพร้อมของไทยในการเข้าเป็นประชาคมเศรษฐกิจอาเซียน	3
ศ.ดร.เกรียงศักดิ์ เจริญวงศ์ศักดิ์	
ความพร้อมของไทยในการเข้าเป็นประชาคมเศรษฐกิจอาเซียน : จุดแข็งและจุดอ่อน	6
ศ.ดร.เกรียงศักดิ์ เจริญวงศ์ศักดิ์	
สถานการณ์บุคลากรด้านการท่องเที่ยวเมื่อเปิดประชาคมเศรษฐกิจอาเซียน	8
รศ.ลำยอง ปลั่งกลาง	
ส่วนที่ 2 บทความจากผู้ร่วมนำเสนอผลงานวิชาการ	
การจัดการเทคโนโลยีการศึกษาศักยภาพวัดดูดิบที่ใช้ผลิตปุ๋ยอินทรีย์ในระดับชุมชนสู่อาเซียน	13
ว่าที่ร้อยเอกธรมพฤษดิ์ เพิ่มเกียรติศักดิ์	
ความสัมพันธ์ระหว่าง เงินบาทและเงินสกุลอาเซียน	22
ศุภศิวิ สุวรรณเกษร	
รูปแบบและกลยุทธ์ธุรกิจค้าปลีก ซี.เจ. เอ็กซ์เพรส (CJ Express)	32
พาโชค ลิ้มเรืองอนันต์	
การตลาดบริการมีผลต่อการตัดสินใจเข้าพักของพนักงานนิคมอุตสาหกรรมสหรัตนนคร	40
อำเภอนครหลวง จังหวัดพระนครศรีอยุธยา	
พิศุทธา ชูสุข	
ทองคำรางวัลแห่งชีวิต : พฤติกรรมการตัดสินใจซื้อทองของลูกค้านร้านทองเตี้ยเฮงหลี	49
ตำบลท่าตูม อำเภอศรีมหาโพธิ์ จังหวัดปราจีนบุรี เพื่อเป็นการให้รางวัลแก่ตัวเอง	
เมธิยา กอสนาน	
ปัจจัยที่ส่งผลต่อความตั้งใจลาออกจากงาน ของพนักงานโรงงานอุตสาหกรรมอิเล็กทรอนิกส์	55
แห่งหนึ่งในเขตนิคมอุตสาหกรรมโรจนะ	
ธนเดช ทองนรินทร์	
การเปลี่ยนแปลงโครงสร้างประชากรกับความเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจ	64
ศุภศิวิ สุวรรณเกษร	
การเตรียมความพร้อมของพนักงานบริษัท ไทยโทรเ เท็กซ์ไทล์มิลลส์ จำกัด (มหาชน)	74
ในการเข้าสู่ประชาคมอาเซียน	
หทัยชนก บุญปลูก	
ความคิดเห็นของนักท่องเที่ยวชาวต่างชาติต่อส่วนประสมการตลาดบริการของที่พักร	79
บนถนนข้าวสาร	
อุทุมพร สุวรรณใจ	

ความสัมพันธ์ระหว่างเงินบาท และเงินสกุลอาเซียน

The Relationship between Baht and Foreign Exchange Rate in ASEAN

ศุภศิรั สุวรรณเกษร Supsi Suwankesorn

อาจารย์ประจำภาควิชาเศรษฐศาสตร์ธุรกิจ คณะวิทยาการจัดการ มหาวิทยาลัยราชภัฏภูเก็ต

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

บทคัดย่อ

การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างเงินบาท และเงินสกุลอาเซียนด้วยแบบจำลองวิธีโคอินทีเกรชันและเอเรอร์คอร์เรชัน มีวัตถุประสงค์เพื่อวิเคราะห์หาความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาว (Cointegration) และวิเคราะห์การปรับตัวเข้าสู่ดุลยภาพในระยะสั้นด้วยแบบจำลอง Error Correction Model (ECM) โดยการวิเคราะห์จะแบ่งออกเป็น 3 ส่วน คือ ส่วนที่หนึ่งเป็นการวิเคราะห์ความนิ่ง (Stationary) โดยใช้วิธี Augmented Dickey-Fuller Test (ADF) ของข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยนต่อ 1 ดอลลาร์สหรัฐของสกุลเงินในอาเซียน ได้แก่ ดอลลาร์บรูไน เรียลกัมพูชา รูเปียห์อินโดนีเซีย กีบลาว เปโซฟิลิปปินส์ ริงกิตมาเลเซีย จ๊าตพม่า ดอลลาร์สิงคโปร์ บาทไทย และเงินด่งเวียดนาม ผลการวิเคราะห์ พบว่า ค่าเงินทั้ง 10 สกุลมีความนิ่งในระดับ Level ดังนั้นจึงสามารถนำค่าเงินทั้ง 9 สกุล มาทำการทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาวกับเงินบาท ด้วยวิธี Cointegration Test ตามแนวคิดของ Johansen (1988) ผลการวิเคราะห์ พบว่า ดอลลาร์บรูไน เรียลกัมพูชา กีบลาว เปโซฟิลิปปินส์ ริงกิตมาเลเซีย ดอลลาร์สิงคโปร์ บาทไทย และเงินด่งเวียดนาม มีความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาวกับเงินบาทไทย

การศึกษาในขั้นต่อไปเป็นการศึกษาลักษณะของการปรับตัวในระยะสั้นเพื่อกลับเข้าสู่ดุลยภาพระยะยาว หากค่าเงินมีการเคลื่อนไหวออกจากดุลยภาพ ด้วย ECM ผลการศึกษาพบว่า ค่าเงินดอลลาร์บรูไน กีบลาว ริงกิตมาเลเซีย ดอลลาร์สิงคโปร์ และเงินด่งเวียดนาม มีการปรับตัวในระยะสั้น แต่ค่าเงินเรียลกัมพูชา และเปโซฟิลิปปินส์ไม่มีการปรับตัวระยะสั้น

คำสำคัญ : ดุลยภาพระยะยาว สกุลเงินอาเซียน แบบจำลองโคอินทีเกรชัน แบบจำลองเอเรอร์คอร์เรชัน

Abstract

The objective of this study were to study the long relationship between Thai Baht And Asian currencies(Cointegrated) and to study the short-run adjustment (ECM) of the foreign exchange rates in ASEAN countries.

The stationary test showed that all variables, namely Dollar Brunei, Riel(Cambodia) Rupiah(Indonesia), Kip(Laos), Peso(Philippine), Ringgit(Malaysia), Kyat (Myanmar), Singapore dollar, Baht(Thailand) and Dong(Vietnam) have the same order of integration at the Level I(0)

The cointegration test showed that Dollar Brunei, Riel(Cambodia), Kip(Laos), Peso (Philippine), Ringgit(Malaysia), Singapore dollar and Dong(Vietnam) have the long-run equilibrium relationship with Baht.

And the analyzed of the short-run adjustment by using ECM show that Dollar Brunei, Kip(Laos), Ringgit(Malaysia), Singapore dollar and Dong(Vietnam) have adaptation in the short term in order to return to the long-run equilibrium relationship with Baht(Thailand) but Riel(Cambodia) and (Philippine) have not.

Keyword : Cointegration, ASEAN Currencies, Cointegration Model, Error Correction Model