

ชิตชัย อยู่พลี 2550: ปัจจัยที่กำหนดการลงทุนโดยตรงของประเทศญี่ปุ่นและผลกระทบต่ออุตสาหกรรมยานยนต์ในประเทศไทยและสาธารณรัฐประชาชนจีน
ปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต สาขาเศรษฐศาสตร์ ภาควิชาเศรษฐศาสตร์ ประธาน
กรรมการที่ปรึกษา: รองศาสตราจารย์จิรพรรณ กุลดิลก, ศ.ม. 128 หน้า

การศึกษานี้มีวัตถุประสงค์เพื่อวิเคราะห์ปัจจัยที่กำหนดการลงทุนทางตรงจากประเทศญี่ปุ่นและผลกระทบต่ออุตสาหกรรมยานยนต์ในประเทศไทยและสาธารณรัฐประชาชนจีนเพื่อเปรียบเทียบปัจจัยและผลกระทบจากการลงทุนจากต่างประเทศระหว่างไทยกับสาธารณรัฐประชาชนจีน การศึกษานี้ได้ใช้ทฤษฎีการลงทุนทางตรงของโคจิม่าเป็นกรอบในการวิเคราะห์ โดยใช้ข้อมูลรายปีในรูปแบบอัตราเจริญเติบโต (Growth) ตั้งแต่ปี พ.ศ. 2523 ถึง พ.ศ. 2548 ระยะเวลา 26 ปี มาวิเคราะห์เชิงปริมาณโดยใช้วิธี Augmented Dickey – Fuller Test (ADF) โดยทำตามลำดับขั้นตอนคือ ทดสอบ Unit Root และใช้วิธีการทดสอบแบบ Two-Step Approach ของ Engel and Granger (1987) ทดสอบความสัมพันธ์ในระยะยาว (Cointegration) และวิเคราะห์เชิงพรรณนาเกี่ยวกับสภาพทั่วไปและผลกระทบจากการลงทุนทางตรงจากญี่ปุ่นต่ออุตสาหกรรมยานยนต์

ผลการทดสอบช่วงความล่าช้าพบว่า ช่วงความล่าช้าที่เหมาะสมของประเทศไทย คือ 1 ช่วงเวลา ส่วนช่วงความล่าช้าที่เหมาะสมของสาธารณรัฐประชาชนจีนคือ ช่วงเวลาปัจจุบันถึง 4 ช่วงเวลา ผลการทดสอบ Unit Root พบว่า ตัวแปรของทั้งสองประเทศมีเสถียรภาพโดยผ่านการทำผลต่างอันดับแรกหรือมีระดับ Integration ที่ 1; $I(1)$ จากการประมาณค่าด้วยวิธีกำลังสองน้อยที่สุด พบว่าปัจจัยที่กำหนดการลงทุนของประเทศไทยและสาธารณรัฐประชาชนจีนคือ มูลค่าผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ อัตราแลกเปลี่ยน ดัชนีราคาผู้บริโภค และอัตราค่าจ้างขั้นต่ำ แม้ว่าดัชนีราคาผู้บริโภค อัตราค่าจ้างขั้นต่ำและการส่งออกของสาธารณรัฐประชาชนจีนมีความสัมพันธ์ทิศทางตรงข้ามกับการลงทุนทางตรงจากญี่ปุ่นและผลการทดสอบความสัมพันธ์ของตัวแปรในระยะยาว (Cointegration) พบว่าการลงทุนทางตรงจากประเทศญี่ปุ่นมีความสัมพันธ์ในระยะยาวกับมูลค่าผลิตภัณฑ์มวลรวมภายใน ประเทศ อัตราแลกเปลี่ยน ดัชนีราคาผู้บริโภคและอัตราค่าจ้างขั้นต่ำ ทั้งประเทศไทยและสาธารณรัฐประชาชนจีน

Thitichai Yooplee 2007: Factors Determination Foreign Direct Investment of Japan and Effects to Automobile Industry in Thailand and The People's Republic of China. Master of Economics, Major Field: Economics, Department of Economics. Thesis Advisor: Associate Professor Chiraphan Kuladilok, M.Econ. 128 pages.

The main purposes of this study; Factors Determination Foreign Direct Investment of Japan and Effects to Automobile Industry in Thailand and The People's Republic of China are as follows to compare the factors determination and impacts of foreign direct investment between Thailand and The People's Republic of China as well as to estimating growth rate parameters. This study used a conceptual framework by consolidating The Foreign Direct Investment of Japan with Kojima Theory. The sample data size 26 years are generated by Augmented Dickey – Fuller Test (ADF) technique that step are unit root test, used The Two-Step Approach by Engel and Granger (1987) for cointegration test, whereas descriptive analysis prescribed general environment and impact on foreign direct investment in Automobile Industry.

From estimate follow by ADF technique, we can conclude that Thailand are more optimal lag at 1 lag. The People's Republic of China are more optimal lag at present to 4 lag. For stationary test by using a unit root technique, Both Thailand and The People's Republic of China have stationary at first different or integration 1; $I(1)$. Both Thailand and The People's Republic of China functions are generated by ordinary least square method that factors determination foreign direct investment of Japan are gross domestic product, consumer price index, exchange rate, minimum wage, export and automobile situation but factors of The People's Republic of China have negative relation with foreign direct investment of Japan that are composes of consumer price index, minimum wage and export. For estimate cointegration conclude that the foreign direct investment of Japan have relationed with all factors for long term.

Student's signature

Thesis Advisor's signature