

ชื่อเรื่องวิทยานิพนธ์ : ผลกระทบของเงินลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศต่อการส่งออกของไทย
ชื่อผู้เขียน : นางสาวสุจิตรา อังพัฒน์รุ่งเรือง
ชื่อปริญญา : เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
ปีการศึกษา : 2545

คณะกรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์ :

1. รองศาสตราจารย์ ดร. ไกร โพธิ์งาม ประธานกรรมการ
2. รองศาสตราจารย์ อติ ไทยานันท์
3. รองศาสตราจารย์ เอกสิทธิ์ เตชะโกสียาณิช

วิทยานิพนธ์นี้ศึกษาถึงผลกระทบของเงินลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศต่อการส่งออกของประเทศไทย มีวัตถุประสงค์เพื่อศึกษาความสัมพันธ์ระหว่างเงินลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศ สินเชื่อเพื่อการส่งออกกับการส่งออกโดยรวมของประเทศไทยทั้งในระยะสั้นและระยะยาว และเพื่อศึกษาหาความรวดเร็วในการปรับตัวเข้าสู่ดุลยภาพของการส่งออกของประเทศไทย ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษาเป็นข้อมูลทุติยภูมิ (Secondary Data) ที่มีลักษณะเป็นข้อมูลรายปีระหว่างปี พ.ศ. 2520-2543 ซึ่งเป็นช่วงที่มีเงินลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศเข้ามาในประเทศไทยเพิ่มมากขึ้นเรื่อย ๆ โดยใช้การทดสอบทางเศรษฐมิติ Cointegration และ Error Correction Model ศึกษาตามวิธี Two-Step Approach ของ Engle and Granger มีผลการศึกษาดังนี้

ผลการทดสอบ Stationary Test ตามวิธี Augmented Dickey Fuller (ADF Test) พบว่า เงินลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศ สินเชื่อเพื่อการส่งออก การส่งออกโดยรวมของประเทศไทยมีลักษณะ Stationary ที่ระดับ first difference หรือ $I(1)$ ทุกตัวแปร และผลการทำ Cointegration Test เพื่อทดสอบหาความสัมพันธ์ในระยะยาว พบว่าตัวแปรมีความสัมพันธ์ในระยะยาว โดยเงินลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศมีความสัมพันธ์ในทิศทางเดียวกันกับการส่งออกโดยรวมของประเทศไทยอย่างมีนัยสำคัญ ณ ระดับความเชื่อมั่น 99% และสินเชื่อเพื่อการส่งออกมีความสัมพันธ์ในทิศทางเดียวกันกับการส่งออกโดยรวมของประเทศไทยอย่างมีนัยสำคัญทางสถิติ ณ ระดับความเชื่อมั่นที่ 90 %

จากการทดสอบการปรับตัวในระยะสั้นของตัวแปรเพื่อให้เข้าสู่ดุลยภาพในระยะยาวตามแบบจำลอง Error Correction Model (ECM) พบว่าค่าที่ดุลยภาพหรือค่าระยะยาวของการส่งออกโดยรวมของประเทศไทยจะถูกปรับให้ลดลงเท่ากับร้อยละ 9.0134 ในแต่ละช่วงเวลา ซึ่งแสดงถึงความรวดเร็วในการปรับตัวเข้าสู่ดุลยภาพในระยะยาว

Thesis Title : The Effect of Foreign Direct Investment to
Thailand 's Export

Student 's Name : Miss Sujitra Angpattanarungruang

Degree Sought : Master of Economics

Academic Year : 2002

Advisory Committee :

1. Assoc. Prof. Dr. Grai Phongarm Chaiperson
2. Assoc. Prof. Ati Thaiyanan
3. Assoc. Prof. Ekasit Dajakaisiyavanit

The purposes of this thesis are to study the relation between foreign direct investment, export credit and total of Thailand 's export in the short-run and the long-run. Speed of adjustment to stability of the Thailand 's export.

Data used in the study were annual secondary data form 1977 to 2000 during which the foreign direct investment has inflow to Thailand continuously. The data were tested by Cointegration and Error Correction technique in accordance with Two-Step Approach of Engle and Granger.

The result of stationary test following the Augmented Dickey Fuller Test (ADF test) shows the foreign direct investment, export credit and total of Thailand 's export are stationary at the first difference (I(1)). The Cointegration test shows that there are long-run positive relationship in every variable, namely, has positive relationship between the foreign direct investment and total of Thailand 's export at 99% level of confidence and has positive relationship between the export credit and total of Thailand 's export at 90% level of confidence

Error Correction technique is employed to find the speed of adjustment toward the long-run stability of the total of Thailand 's export. From Error Correction Model test shows the long-run of total of Thailand 's export error correction in each time equal 9.0134.