

ชื่อเรื่องการค้นคว้าแบบอิสระ ความสัมพันธ์ระหว่างการลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศกับตัวแปรทางเศรษฐกิจในกลุ่มประเทศ จี20 โดยวิธีเออาร์ดีแอล

ผู้เขียน นายปรภากร สมร่วง

ปริญญา เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ

อ.ดร.รสริน โอสถานันต์กุล

ประธานกรรมการ

รศ.ดร.วินัส ฤชัย

กรรมการ

### บทคัดย่อ

การศึกษานี้มีวัตถุประสงค์เพื่อจะหาความสัมพันธ์ระหว่างการลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศกับตัวแปรทางเศรษฐกิจของประเทศในกลุ่ม จี20 อันประกอบด้วย ประเทศญี่ปุ่น สหราชอาณาจักร อาร์เจนตินา อินโดนีเซีย เม็กซิโก และตุรกี โดยตัวแปรทางเศรษฐกิจที่ใช้ในการศึกษาได้แก่ มูลค่าผลิตภัณฑ์มวลรวมในประเทศเบื้องต้น อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราระหว่างประเทศ ดัชนีราคาผู้บริโภค อัตราดอกเบี้ยเงินกู้ในประเทศ และมูลค่าการส่งออกของแต่ละประเทศ โดยใช้ข้อมูลทศนิยม ซึ่งเป็นข้อมูลอนุกรมเวลารายไตรมาส ตั้งแต่ พ.ศ. 2536 ไตรมาสที่ 4 ถึง พ.ศ. 2552 ไตรมาสที่ 1 โดยประยุกต์ใช้เทคนิคโคอินทิเกรชันด้วยวิธีเออาร์ดีแอล (ARDL Approach to Cointegration)

จากผลการศึกษาการลงทุนโดยตรงระหว่างประเทศกับตัวแปรทางเศรษฐกิจพบว่าทุกประเทศที่ทำการศึกษามีความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาว โดยในระยะสั้นพบว่าตัวแปรที่ใช้ทดสอบในแบบจำลองเอเรอร์คอร์เรชันที่ได้เลือกโดยวิธีเออาร์ดีแอลมีการปรับตัวในระยะสั้นเพื่อเข้าสู่ดุลยภาพในระยะยาว

**Independent Study Title**                   The Relationship Between Foreign Direct Investment  
and Economic Variables of G20 Member Countries  
Using ARDL Method

**Author**   Mr.Prakarn Somrang

**Degree**   Master of Economics

**Independent Study Advisory Committee**

Lect.Dr.Rossarin Osathanukul

Chairperson

Assoc.Prof.Dr.Venus Rauechai

Member

**ABSTRACT**

The purpose of this study is to examine the relationship between Foreign Direct Investment and Economic Variables of G20 Member Countries including Japan, United Kingdom, Argentina, Indonesia, Mexico, and Turkey. The economic variables in this study were Gross Domestic Product, Exchange Rate, Consumer Price Index, Lending Rate and Export Value. The secondary data of economic variables in the study were gathered quarterly, covering from 1993 to 2009. The bounds test (ARDL) approach to cointegration was employed in this study.

The results of the study show cointegration relations between Foreign Direct Investment and economic variables for every countries. The ECM selected based on ARDL test indicates that those economic variables have a short run adaptation towards a long run equilibrium.

ลิขสิทธิ์ในผลงานนี้สงวนไว้  
Copyright © by Chiang Mai University  
All rights reserved