

ชื่อเรื่องการค้าค้นคว้าแบบอิสระ

การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลต่อการส่งออก สินค้ารถยนต์
อุปกรณ์และส่วนประกอบ โดยวิธีพหุคูณกรุป

ผู้เขียน

นางสาวปิยพร ประพันธ์พจน์

ปริญญา

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้าค้นคว้าแบบอิสระ

อ.ดร.ชูเกียรติ ชัยบุญศรี อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก
อ.ดร.อนุภาค เสาร์เสาวภาคย์ อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

บทคัดย่อ

การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลต่อมูลค่าการส่งออกของสินค้ารถยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของประเทศไทย มีวัตถุประสงค์เพื่อศึกษาปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อมูลค่าการส่งออกสินค้ารถยนต์ ๑ และวิเคราะห์ความสัมพันธ์ทั้งระยะสั้นและระยะยาว โดยใช้ข้อมูลทศวรรษ รายปีตั้งแต่ปี พ.ศ. 2540-2554 เป็นข้อมูลทางเศรษฐกิจของประเทศผู้นำเข้า 5 อันดับแรก ได้แก่ประเทศออสเตรเลีย ประเทศอินโดนีเซีย ประเทศญี่ปุ่น ประเทศมาเลเซีย และประเทศซาอุดีอาระเบีย ในการศึกษาครั้งนี้มีขั้นตอนในการศึกษา 3 ขั้นตอน 1) การทดสอบความนิ่งของตัวแปร (Unit Root Test) 2) การทดสอบความสัมพันธ์ของตัวแปร (Panel Cointegration Test) 3) การประมาณค่าโดย วิธีพหุคูณกรุป (Pooled Mean Group Estimator)

ผลการศึกษาพบว่าตัวแปร มูลค่าการส่งออกของสินค้ารถยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบของประเทศไทย อัตราเงินเฟ้อภายในประเทศของประเทศผู้นำเข้า อัตราการว่างงานของประเทศผู้นำเข้า และจำนวนประชากรของประเทศผู้นำเข้า มีความนิ่งของข้อมูลอยู่ที่ระดับ Level หรือ $I(0)$ สำหรับตัวแปร ผลผลิตมวลรวมภายในประเทศของประเทศผู้นำเข้า และอัตราแลกเปลี่ยนเงินตรา ระหว่างประเทศของประเทศผู้นำเข้า มีความนิ่งอยู่ที่ระดับ 1^{st} different ในการหาความสัมพันธ์ของตัวแปรพบว่า ตัวแปรทุกตัวมีลักษณะ Panel Cointegration โดยมีนัยสำคัญที่ 0.01 อันดับสุดท้ายเป็นการประมาณค่าโดยวิธีพหุคูณกรุป (Pooled Mean Group Estimator) ในภาพรวมพบว่าตัวแปรทุกตัว

มีความสัมพันธ์กับมูลค่าการส่งออกของสินค้ารถยนต์ ฯ ในทิศทางเดียวกัน และมีระดับนัยสำคัญทางสถิติ ยกเว้น ตัวแปรจำนวนประชากรของประเทศผู้นำเข้ามีความสัมพันธ์ไปในทิศทางตรงกันข้ามกับมูลค่าการส่งออกของสินค้ารถยนต์ ฯ สำหรับการศึกษาความสัมพันธ์ในระยะยาวพบว่า ประเทศออสเตรเลีย ประเทศอินโดนีเซีย และประเทศซาอุดีอาระเบีย มีความสัมพันธ์กับมูลค่าการส่งออกสินค้ารถยนต์ ฯ ในระยะยาว ยกเว้น ประเทศญี่ปุ่นและประเทศมาเลเซียที่ไม่มีความสัมพันธ์กับมูลค่าการส่งออกสินค้ารถยนต์ ฯ จากประเทศไทยในระยะยาว

Independent Study Title

Analysis of Factors Affecting the Exports of
Automobiles Accessories and Components
Using the Pooled Mean Group Estimator

Author

Miss Piyapond Prapunpoj

Degree

Master of Economics

Independent Study Advisory Committee

Dr. Chukiat Chaiboonsri

Advisor

Dr. Anuphak Saosaovaphak

Co-advisor

ABSTRACT

The study of the analysis of factors affecting the export of automobiles accessories and components in Thailand attempts to investigate the factors that affect the export value of automobiles accessories and components, and to analyze both short-run and long-run correlations of these factors, using annual economic reports during 1997-2011 of the top five leading importers including Australia, Indonesia, Japan, Malaysia and Saudi Arabia. In so doing, the study conducted (1) a Unit Root Test, (2) a Panel Cointegration Test, and (3) a Pooled Mean Group Analysis.

The results of the study reveal that the variables including the export value of automobiles accessories and components in Thailand, inflation rate of the importers, unemployment rate of the importers, and number of populations of the importers were stationary at level or $I(0)$. Gross Domestic Product and the exchange rate of the importers were stationary at 1st different. The Panel Conintegration Test illustrated that all the variables were cointegrated at the 0.01 significance level.

Lastly, the Pooled Mean Group Analysis demonstrated that all the variables were significantly positively correlated with the export value of automobiles accessories and components except the number of population of importers that were negatively correlated with the export value of automobiles accessories and components. For the study of the long-run correlation, the study found that the variables of Australia, Indonesia and Saudi Arabia were correlated with the export value of automobiles accessories and components in long-run. In contrast, the variables of Japan and Malaysia were not correlated with the export value of automobiles accessories and components in long-run.