

ภาคผนวก ข

การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของข้อมูล

การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของข้อมูล

ตารางผนวกที่ 1 การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของตัวแปร (π_t)

At Level				
Null Hypothesis: INF has a unit root				
Exogenous: Constant, Linear Trend				
Lag length: 0 (Spectral OLS AR based on AIC, MAXLAG=8)				
			Adj. t-Stat	Prob.*
Phillips-Perron test statistic			-3.812221	0.0247
Test critical values:	1% level	-4.170583		
	5% level	-3.510740		
	10% level	-3.185512		
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
INF(-1)	-0.480255	0.125978	-3.812221	0.0004
C	0.795913	0.273473	2.910385	0.0057
@TREND(1993:1)	-0.014741	0.007704	-1.913383	0.0624
At First Difference				
Null Hypothesis: D(INF) has a unit root				
Exogenous: None				
Lag length: 0 (Spectral OLS AR based on AIC, MAXLAG=8)				
			Adj. t-Stat	Prob.*
Phillips-Perron test statistic			-7.751923	0.0000
Test critical values:	1% level	-2.617364		
	5% level	-1.948313		
	10% level	-1.612229		
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
D(INF(-1))	-1.126700	0.145345	-7.751923	0.0000

ตารางผนวกที่ 2 การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของตัวแปร (y_t)

At Level				
Null Hypothesis: Y has a unit root				
Exogenous: Constant, Linear Trend				
Lag length: 5 (Spectral OLS AR based on AIC, MAXLAG=8)				
			Adj. t-Stat	Prob.*
Phillips-Perron test statistic			-41.25016	0.0000
Test critical values:	1% level	-4.170583		
	5% level	-3.510740		
	10% level	-3.185512		
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
Y(-1)	-0.182426	0.087246	-2.090933	0.0425
C	169098.0	72832.52	2.321737	0.0251
@TREND(1993:1)	2630.379	1338.647	1.964953	0.0559

ตารางผนวกที่ 2 (ต่อ)

At First Difference				
Null Hypothesis: D(Y) has a unit root				
Exogenous: Constant				
Lag length: 3 (Spectral OLS AR based on AIC, MAXLAG=8)				
			Adj. t-Stat	Prob.*
Phillips-Perron test statistic			-12.00792	0.0000
Test critical values:	1% level		-3.584743	
	5% level		-2.928142	
	10% level		-2.602225	
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
D(Y(-1))	-0.951851	0.152527	-6.240527	0.0000
C	18208.58	6771.857	2.688860	0.0102

ตารางผนวกที่ 3 การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของตัวแปร (GM1_t)

At Level				
Null Hypothesis: GM1 has a unit root				
Exogenous: Constant				
Lag length: 3 (Spectral OLS AR based on AIC, MAXLAG=8)				
			Adj. t-Stat	Prob.*
Phillips-Perron test statistic			-12.89938	0.0000
Test critical values:	1% level		-3.581152	
	5% level		-2.926622	
	10% level		-2.601424	
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
GM1(-1)	-1.032856	0.150699	-6.853782	0.0000
C	2.685828	0.827379	3.246187	0.0022
At First Difference				
Null Hypothesis: D(GM1) has a unit root				
Exogenous: None				
Lag length: 2 (Spectral OLS AR based on AIC, MAXLAG=8)				
			Adj. t-Stat	Prob.*
Phillips-Perron test statistic			-15.32438	0.0000
Test critical values:	1% level		-2.617364	
	5% level		-1.948313	
	10% level		-1.612229	
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
D(GM1(-1))	-1.255060	0.145361	-8.634104	0.0000

ตารางผนวกที่ 4 การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของตัวแปร ($GM2_t$)

At Level				
Null Hypothesis: GM2 has a unit root				
Exogenous: Constant, Linear Trend				
Lag length: 0 (Spectral OLS AR based on AIC, MAXLAG=8)				
			Adj. t-Stat	Prob.*
Phillips-Perron test statistic			-4.463905	0.0045
Test critical values:	1% level		-4.170583	
	5% level		-3.510740	
	10% level		-3.185512	
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
GM2(-1)	-0.631910	0.141560	-4.463905	0.0001
C	2.686736	0.738312	3.639025	0.0007
@TREND(1993:1)	-0.053299	0.018918	-2.817358	0.0073
At First Difference				
Null Hypothesis: D(GM2) has a unit root				
Exogenous: None				
Lag length: 5 (Spectral OLS AR based on AIC, MAXLAG=8)				
			Adj. t-Stat	Prob.*
Phillips-Perron test statistic			-12.02362	0.0000
Test critical values:	1% level		-2.617364	
	5% level		-1.948313	
	10% level		-1.612229	
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
D(GM2(-1))	-1.172347	0.149544	-7.839467	0.0000

ตารางผนวกที่ 5 การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของตัวแปร (G_t)

At Level				
Null Hypothesis: G has a unit root				
Exogenous: Constant, Linear Trend				
Lag length: 1 (Spectral OLS AR based on AIC, MAXLAG=8)				
			Adj. t-Stat	Prob.*
Phillips-Perron test statistic			-4.493047	0.0042
Test critical values:	1% level		-4.170583	
	5% level		-3.510740	
	10% level		-3.185512	
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
G(-1)	-0.656693	0.139093	-4.721255	0.0000
C	96896.99	20624.44	4.698164	0.0000
@TREND(1993:1)	1686.923	451.1207	3.739404	0.0005

ตารางผนวกที่ 5 (ต่อ)

At First Difference				
Null Hypothesis: D(G) has a unit root				
Exogenous: None				
Lag length: 0 (Spectral OLS AR based on AIC, MAXLAG=8)				
			Adj. t-Stat	Prob.*
Phillips-Perron test statistic			-11.31313	0.0000
Test critical values:	1% level		-2.617364	
	5% level		-1.948313	
	10% level		-1.612229	
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
D(G(-1))	-1.483300	0.131113	-11.31313	0.0000

ตารางผนวกที่ 6 การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของตัวแปร (BP_t)

At Level				
Null Hypothesis: BP has a unit root				
Exogenous: None				
Lag length: 1 (Spectral OLS AR based on AIC, MAXLAG=8)				
			Adj. t-Stat	Prob.*
Phillips-Perron test statistic			-4.945659	0.0000
Test critical values:	1% level		-2.616203	
	5% level		-1.948140	
	10% level		-1.612320	
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
BP(-1)	-0.748106	0.145331	-5.147593	0.0000
At First Difference				
Null Hypothesis: D(BP) has a unit root				
Exogenous: None				
Lag length: 0 (Spectral OLS AR based on AIC, MAXLAG=8)				
			Adj. t-Stat	Prob.*
Phillips-Perron test statistic			-13.17357	0.0000
Test critical values:	1% level		-2.617364	
	5% level		-1.948313	
	10% level		-1.612229	
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
D(BP(-1))	-1.594954	0.121072	-13.17357	0.0000

ตารางผนวกที่ 7 การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของตัวแปร $(M1/P)_t$

At Level				
Null Hypothesis: M1_P has a unit root				
Exogenous: None				
Lag length: 4 (Spectral OLS AR based on AIC, MAXLAG=8)				
			Adj. t-Stat	Prob.*
Phillips-Perron test statistic			1.719623	0.9778
Test critical values:	1% level	-2.616203		
	5% level	-1.948140		
	10% level	-1.612320		
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
M1_P(-1)	0.015832	0.007180	2.204931	0.0326
At First Difference				
Null Hypothesis: D(M1_P) has a unit root				
Exogenous: Constant				
Lag length: 3 (Spectral OLS AR based on AIC, MAXLAG=8)				
			Adj. t-Stat	Prob.*
Phillips-Perron test statistic			-12.81582	0.0000
Test critical values:	1% level	-3.584743		
	5% level	-2.928142		
	10% level	-2.602225		
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
D(M1_P(-1))	-0.992827	0.152660	-6.503523	0.0000
C	83.44475	40.03020	2.084545	0.0431

ตารางผนวกที่ 8 การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของตัวแปร $(M2/P)_t$

At Level				
Null Hypothesis: M2_P has a unit root				
Exogenous: None				
Lag length: 1 (Spectral OLS AR based on AIC, MAXLAG=8)				
			Adj. t-Stat	Prob.*
Phillips-Perron test statistic			3.445408	0.9997
Test critical values:	1% level	-2.616203		
	5% level	-1.948140		
	10% level	-1.612320		
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
M2_P(-1)	0.010830	0.002123	5.101619	0.0000

ตารางผนวกที่ 8 การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของตัวแปร $(M2/P)_t$

At First Difference				
Null Hypothesis: D(M2_P) has a unit root				
Exogenous: Constant, Linear Trend				
Lag length: 2 (Spectral OLS AR based on AIC, MAXLAG=8)				
			Adj. t-Stat	Prob.*
Phillips-Perron test statistic			-12.18822	0.0000
Test critical values:	1% level		-4.175640	
	5% level		-3.513075	
	10% level		-3.186854	
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
D(M2_P(-1))	-0.815977	0.152386	-5.354675	0.0000
C	801.5044	240.5162	3.332435	0.0018
@TREND(1993:1)	-14.35487	7.248467	-1.980401	0.0542

ตารางผนวกที่ 9 การทดสอบคุณสมบัติความนิ่งของตัวแปร (g_t)

At Level				
Null Hypothesis: G_P has a unit root				
Exogenous: Constant, Linear Trend				
Lag length: 1 (Spectral OLS AR based on AIC, MAXLAG=8)				
			Adj. t-Stat	Prob.*
Phillips-Perron test statistic			-4.595159	0.0032
Test critical values:	1% level		-4.170583	
	5% level		-3.510740	
	10% level		-3.185512	
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
G_P(-1)	-0.661886	0.138219	-4.788693	0.0000
C	1343.771	281.8499	4.767684	0.0000
@TREND(1993:1)	6.746236	3.242898	2.080311	0.0435
At First Difference				
Null Hypothesis: D(G_P) has a unit root				
Exogenous: None				
Lag length: 0 (Spectral OLS AR based on AIC, MAXLAG=8)				
			Adj. t-Stat	Prob.*
Phillips-Perron test statistic			-11.41957	0.0000
Test critical values:	1% level		-2.617364	
	5% level		-1.948313	
	10% level		-1.612229	
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
D(G_P(-1))	-1.486155	0.130141	-11.41957	0.0000