

ภาคผนวก จ

การวิเคราะห์ Variance Decomposition ของแบบจำลอง Vector Error Correction Model

ตารางที่ จ.1

Variance Decomposition ของแบบจำลอง VEC

แบบจำลอง	ตัวแปร shock	ลำดับสัดส่วน Shock ของ ตัวแปร*						
		1	2	3	4	5	6	7
Linear	Lroil	Lroil (72.6%)	core (42.1%)	rp (31.1%)	Lrgdp (8.60%)	reer (2.40%)	Lrwage (1.04%)	
	Lrgdp	Lrgdp (52.8%)	Lroil (2.16%)	reer (1.50%)	Lrwage (0.14%)	rp (0.12%)	core (0.04%)	
	core	core (54.0%)	rp (47.3%)	Lrwage (45.01%)	reer (17.5%)	Lroil (13.2%)	Lrgdp (6.1%)	
	rp	rp (20.3%)	Lroil (6.9%)	core (2.41%)	Lrgdp (1.0%)	Lrwage (0.5%)	reer (0.3%)	
	Lrwage	Lrwage (50.4%)	Lrgdp (25.2%)	reer (20.39%)	Lroil (2.16%)	core (0.38%)	rp (0.09%)	
	reer	reer (57.7%)	Lrgdp (5.9%)	Lroil (2.81%)	Lrwage (2.7%)	core (0.9%)	rp (0.8%)	
	Asymmetric	O ⁺	O ⁺ (54.0%)	rp (33.5%)	core (28.59%)	O ⁻ (13.0%)	Lrwage (11.3%)	Lrgdp (2.2%)
O ⁻		O ⁻ (47.2%)	O ⁺ (26.9%)	rp (17.15%)	reer (9.1%)	core (8.8%)	Lrwage (6.8%)	Lrgdp (3.6%)
Lrgdp		Lrgdp (39.8%)	reer (9.74%)	O ⁻ (0.74%)	rp (0.6%)	Lrwage (0.5%)	O ⁺ (0.4%)	core (0.3%)
core		core (56.6%)	reer (35.0%)	rp (28.46%)	Lrwage (22.9%)	Lrgdp (15.2%)	O ⁻ (7.6%)	O ⁺ (2.7%)
rp		rp (18.1%)	O ⁺ (7.2%)	Lrwage (3.00%)	O ⁻ (1.5%)	reer (1.4%)	Lrgdp (1.2%)	core (1.0%)

หมายเหตุ *เรียงตามลำดับจากสัดส่วนมากที่สุดไปน้อยที่สุด

ตารางที่ ๑.1 (ต่อ)

แบบจำลอง	ตัวแปร shock	ลำดับสัดส่วน Shock ของ ตัวแปร*						
		1	2	3	4	5	6	7
Asymmetric	Lrwage	Lrwage (52.5%)	Lrgdp (37.1%)	O ⁻ (25.13%)	reer (14.6%)	core (3.3%)	rp (2.0%)	O ⁺ (1.7%)
	reer	reer (28.0%)	O ⁺ (6.8%)	O ⁻ (4.47%)	Lrwage (2.9%)	core (1.2%)	Lrgdp (0.6%)	rp (0.0%)
nopi	nopi	Lrgdp (31.79%)	reer (4.51%)	lrwage (1.40%)	nopi (1.40%)	core (0.43%)	rp (0.28%)	
	Lrgdp	Lrgdp (40.72%)	rp (8.98%)	nopi (3.60%)	core (1.29%)	reer (0.29%)	Lrwage (0.25%)	
	core	rp (40.19%)	Lrgdp (33.42%)	reer (26.90%)	core (24.74%)	nopi (3.17%)	Lrwage (0.60%)	
	rp	rp (37.36%)	Lrwage (29.13%)	nopi (3.28%)	core (0.89%)	Lrgdp (0.83%)	reer (0.75%)	
	Lrwage	core (52.64%)	Lrwage (45.35%)	Lrgdp (14.98%)	nopi (9.87%)	rp (8.53%)	reer (0.63%)	
	reer	reer (56.31%)	Lrwage (22.50%)	core (9.66%)	nopi (8.35%)	rp (2.98%)	Lrgdp (1.98%)	

หมายเหตุ *เรียงตามลำดับจากสัดส่วนมากที่สุดไปน้อยที่สุด