

ภาคผนวก ข

การวิเคราะห์ Variance Decomposition ของแบบจำลอง Vector Error Correction Model

ตารางที่ ข.1

Variance Decomposition ของแบบจำลอง VEC ในอันดับ Cholesky

แบบจำลอง	ตัวแปร	ลำดับสัดส่วน Shock ของ ตัวแปร*						
		1	2	3	4	5	6	7
Linear	Lroil	Lroil (47.0%)	reer (1.79%)	core (1.63%)	Lrgdp (1.20%)	rp (0.54%)	Lrwage (0.16%)	
	Lrgdp	Lrgdp (73.59%)	core (40.58%)	rp (30.77%)	Lroil (14.42%)	reer (2.16%)	Lrwage (1.03%)	
	core	core (54.05%)	rp (47.38%)	Lrwage (45.01%)	reer (17.57%)	Lrgdp (13.22%)	Lroil (6.18%)	
	rp	rp (20.38%)	Lrgdp (6.99%)	core (2.41%)	Lroil (1.06%)	Lrwage (0.53%)	reer (0.37%)	
	Lrwage	Lrwage (50.49%)	Lroil (25.25%)	reer (20.39%)	Lrgdp (2.16%)	rp (0.93%)	core (0.39%)	
	reer	reer (57.70%)	Lroil (5.98%)	Lrgdp (2.81%)	Lrwage (2.76%)	core (0.92%)	rp (0.82%)	
Asymmetric	O ⁺	O ⁺ (41.51%)	reer (7.09%)	rp (2.5%)	core (1.55%)	Lrgdp (1.10%)	O ⁻ (0.89%)	Lrwage (0.42%)
	O ⁻	O ⁻ (54.18%)	rp (32.68%)	core (27.94%)	Lrgdp (12.97%)	Lrwage (11.17%)	reer (2.22%)	O ⁺ (2.10%)
	Lrgdp	Lrgdp (46.99%)	O ⁻ (26.36%)	rp (16.09%)	reer (11.49%)	core (8.28%)	Lrwage (7.07%)	O ⁺ (2.13%)
	core	core (56.62%)	reer (35.01%)	rp (28.47%)	Lrwage (22.90%)	O ⁺ (15.24%)	Lrgdp (7.68%)	O ⁻ (2.78%)
	rp	rp (18.13%)	O ⁻ (7.20%)	Lrwage (3.00%)	Lrgdp (1.56%)	reer (1.43%)	O ⁺ (1.29%)	core (1.05%)
	Lrwage	Lrwage (52.50%)	O ⁺ (37.11%)	Lrgdp (25.19%)	reer (14.63%)	core (3.30%)	rp (2.01%)	O ⁻ (1.70%)
	reer	reer (28.08%)	O ⁻ (6.85%)	Lrgdp (4.47%)	Lrwage (2.92%)	core (1.24%)	O ⁺ (0.60%)	rp (0.02%)

หมายเหตุ *เรียงตามลำดับจากสัดส่วนมากที่สุดไปน้อยที่สุด

ตารางที่ ข.1

Variance Decomposition ของแบบจำลอง VEC ในอันดับ Cholesky¹ (ต่อ)

แบบจำลอง	ตัวแปร shock	ลำดับสัดส่วน Shock ของ ตัวแปร*					
		1	2	3	4	5	6
Net	nopi	nopi (44.70%)	rp (9.83%)	Lrgdp (2.56%)	core (2.43%)	Lrwage (0.28%)	reer (0.19%)
	Lrgdp	Lrgdp (72.75%)	reer (15.18%)	core (9.61%)	nopi (4.06%)	Lrwage (2.11%)	rp (1.07%)
	core	rp (40.19%)	nopi (33.42%)	reer (26.90%)	core (24.74%)	Lrgdp (3.17%)	Lrwage (0.60%)
	rp	rp (37.36%)	Lrwage (29.13%)	Lrgdp (3.28%)	core (0.89%)	nopi (0.83%)	reer (0.75%)
	Lrwage	core (52.64%)	Lrwage (45.35%)	nopi (14.98%)	Lrgdp (9.87%)	rp (8.53%)	reer (0.63%)
	reer	reer (56.31%)	Lrwage (22.50%)	core (9.66%)	Lrgdp (8.35%)	rp (2.98%)	nopi (1.98%)

หมายเหตุ *เรียงตามลำดับจากสัดส่วนมากที่สุดไปน้อยที่สุด