

ผนวก ข

ผลการศึกษาหลังแก้ปัญหา Autocorrelation

ตารางที่ ข.1

การบรรเทาปัญหา Autocorrelation ของสมการถดถอย โดยใช้ 1st Order Auto Regressive
กรณีขนาดรัฐบาลที่วัดจากสัดส่วนรายจ่ายเพื่อการบริโภคของรัฐบาลที่แท้จริง
ต่อผลิตภัณฑ์มวลรวมในประเทศที่แท้จริง

Dependent Variable: YGROWTH

Method: Least Squares

Date: 12/12/07 Time: 18:35

Sample (adjusted): 1959 2005

Included observations: 47 after adjustments

Convergence achieved after 44 iterations

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.012413	0.027744	-0.447409	0.6569
IDIVY	0.296493	0.118322	2.505822	0.0162
LGROWTH	0.287208	0.164088	1.750334	0.0874
GCGROWTH*GCDIVY	1.190073	0.916669	1.298258	0.2013
AR(1)	0.385328	0.150822	2.554861	0.0143
R-squared	0.391300	Mean dependent var		0.068153
Adjusted R-squared	0.333329	S.D. dependent var		0.038394
S.E. of regression	0.031349	Akaike info criterion		-3.986999
Sum squared resid	0.041275	Schwarz criterion		-3.790174
Log likelihood	98.69447	F-statistic		6.749882
Durbin-Watson stat	1.793101	Prob(F-statistic)		0.000274
Inverted AR Roots	.39			

ที่มา : จากการคำนวณ

ตารางที่ ๑.๒

การบรรเทาปัญหา Autocorrelation ของสมการถดถอย โดยใช้ 1st Order Auto Regressive
 กรณีขนาดรัฐบาลที่วัดจากสัดส่วนรายจ่ายเพื่อการลงทุนของรัฐบาลที่แท้จริง
 ต่อผลิตภัณฑ์มวลรวมในประเทศที่แท้จริง

Dependent Variable: YGROWTH

Method: Least Squares

Date: 12/12/07 Time: 18:45

Sample (adjusted): 1959 2005

Included observations: 47 after adjustments

Convergence achieved after 216 iterations

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.004613	0.027506	0.167711	0.8676
IDIVY	0.219952	0.121946	1.803685	0.0785
LGROWTH	0.287135	0.151670	1.893158	0.0652
GIGROWTH*GIDIVY	1.125023	0.398339	2.824287	0.0072
AR(1)	0.412893	0.152002	2.716374	0.0095
R-squared	0.466427	Mean dependent var		0.068153
Adjusted R-squared	0.415611	S.D. dependent var		0.038394
S.E. of regression	0.029350	Akaike info criterion		-4.118729
Sum squared resid	0.036181	Schwarz criterion		-3.921904
Log likelihood	101.7901	F-statistic		9.178671
Durbin-Watson stat	1.740492	Prob(F-statistic)		0.000020
Inverted AR Roots	.41			

ที่มา : จากการคำนวณ

ตารางที่ ๓.3

การบรรเทาปัญหา Autocorrelation ของสมการถดถอย โดยใช้ 1st Order Auto Regressive
 กรณีขนาดรัฐบาลที่วัดจากสัดส่วนรายจ่ายทั้งหมดของรัฐบาลที่แท้จริง
 ต่อผลิตภัณฑ์มวลรวมในประเทศที่แท้จริง

Dependent Variable: YGROWTH

Method: Least Squares

Date: 12/12/07 Time: 18:50

Sample (adjusted): 1959 2005

Included observations: 47 after adjustments

Convergence not achieved after 500 iterations

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.001192	0.027840	-0.042825	0.9660
IDIVY	0.223885	0.124184	1.802843	0.0786
LGROWTH	0.273607	0.147954	1.849270	0.0715
GTGROWTH*GTDIVY	1.010513	0.324459	3.114458	0.0033
AR(1)	0.449209	0.149262	3.009542	0.0044
R-squared	0.481107	Mean dependent var		0.068153
Adjusted R-squared	0.431689	S.D. dependent var		0.038394
S.E. of regression	0.028944	Akaike info criterion		-4.146627
Sum squared resid	0.035185	Schwarz criterion		-3.949803
Log likelihood	102.4457	F-statistic		9.735402
Durbin-Watson stat	1.698832	Prob(F-statistic)		0.000012
Inverted AR Roots	.45			

ที่มา : จากการคำนวณ