

สารบัญตาราง

ตารางที่	หน้า
1.1 มูลค่าตราสารหนี้ที่ขึ้นทะเบียนในระบบของชมรมผู้ค้าตราสารหนี้ในช่วงปี พ.ศ. 2536-2546.....	2
5.1 ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ของตัวแปรในแบบจำลองด้วยวิธี Unit Root ที่ค่าระดับของข้อมูล (At Level).....	52
5.2 ค่าสถิติเชิงพรรณนาของตัวแปรที่ใช้ในการศึกษา.....	52
5.3 ค่าพารามิเตอร์สัมประสิทธิ์สหสัมพันธ์ระหว่างตัวแปรที่นำมาศึกษา.....	53
5.4 การทดสอบหาจำนวนความล่าช้าที่เหมาะสมโดย Likelihood Ratio Test	53
5.5 ผลการกำหนดค่าพารามิเตอร์ตัวแบบจำลอง VAR ของอัตราผลตอบแทนส่วนเกินจากการลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล.....	54
5.6 ค่าสถิติ Wald Test ของการทดสอบความเป็นเชิงเส้นและการหาตัวแปรบ่งชี้.....	58
5.7 ค่าสถิติ Wald Test ของการหาฟังก์ชันการเปลี่ยนแปลง (Transition Function).....	58
5.8 ผลการกำหนดพารามิเตอร์ของสมการอัตราผลตอบแทนส่วนเกินจากการลงทุนในพันธบัตรรัฐบาลในตัวแบบจำลอง Vector STAR.....	59
5.9 ผลการทดสอบการมีลักษณะในตัวแบบจำลอง STAR ของกลุ่มสมการ.....	62
5.10 เปรียบเทียบความสามารถในการพยากรณ์ของตัวแบบจำลอง Vector STAR กับ ตัวแบบจำลอง VAR	66
5.11 ผลการทดสอบความแม่นยำในการพยากรณ์ระหว่างตัวแบบจำลอง Vector STAR กับ ตัวแบบจำลอง VAR	67