สำนักงานคณะกรรมการวิจัยแห่งชาติ ห้องสมุดงานวิจัย

เอกสารอ้างอิง

เกริกเกียรติ พิพัฒน์เสรีธรรม. 2552. **การคลังว่าด้วยการจัดสรรและการกระจาย.** พิมพ์ครั้งที่ 9. กรุงเทพฯ : สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์

ณัฐชยา บุญปลอด. 2554. **ผลกระทบการใช้จ่ายของรัฐบาลด้านสาธารณสุขต่อการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของกลุ่มประเทศในเอเชียตะออกเฉียงใต้.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร-มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ปรีดา ใจท้วม. 2553. **การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างรายจ่ายประจำ รายจ่ายลงทุนของรัฐบาลและผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร-มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ปาณิสรา สุขพัฒน์. 2551. **ความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณรายจ่ายด้านการศึกษาของรัฐบาลและการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร-มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐมิติทฤษฎีและการประยุกต์.** เชียงใหม่. คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ทับทิม วงศ์ประยูร. 2542. **เศรษฐศาสตร์การพัฒนาเบื้องต้น.** กรุงเทพฯ : ธรรมสารการพิมพ์

นิศานาถ นิศากรเกรียงเดช. 2548. **การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการใช้จ่ายของรัฐบาลกับการเติบโตทางเศรษฐกิจของไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

"ภาพรวมเศรษฐกิจมหภาค" 2554. (18 พฤษภาคม 2555) แหล่งที่มา: http://siteresources.worldbank.org/INTTHAILANDINTHAI/Resources/TEMChap2.pdf

รณชิต สมมิตร. 2550. **บทบาทการใช้จ่ายของภาครัฐต่อตัวแปรทางเศรษฐศาสตร์มหภาคของประเทศไทย.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

รัตนา สายคณิต. 2539. **มหเศรษฐศาสตร์วิเคราะห์ : จากทฤษฎีสู่นโยบาย.** พิมพ์ครั้งที่ 2 กรุงเทพฯ : คณะเศรษฐศาสตร์จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

วันวสา วิโรจนารมย์. 2551. **การประมาณอุปสงค์การท่องเที่ยวของนักท่องเที่ยวต่างชาติในประเทศไทย โดยใช้ข้อมูลไม่นิ่ง.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง. 2555. **วิกฤติเศรษฐกิจสู่วิกฤติการเมืองยุโรปทางออกหรือทางตัน.** กรุงเทพฯ: สำนักนโยบายเศรษฐกิจมหภาค.

เสาวลักษณ์ คำวิลัยศักดิ์. 2555. **การควบคุมเงินทุนเคลื่อนย้าย.** แหล่งที่มา http://www.mfcfund.com/mfc/index.php?option=com_content&view=article&id=1110&Itemid=92&lang=th (22 พฤษภาคม 2555)

Baltagi, Badi Ho. 2001. **Econometric analysis of panel data. 2nd** ed. West Sussex: John Wiley & Son.

Badi H. Baltagi. 2005. **Econometric analysis of panel data.** 3rded.West Sussex: John Wiley &Son.

Breitung, J. 2000. **The local power of some unit root tests for panel data.** [Online]. Available:http://www.mathmatics.Uni-bonn.de/publications/breitung.pdf

Choi, I. 2001. **Unit root test for panel data.** Journal of International Money and Finance 20:249-272.

Granger, C.W.J. 1969. Investigation Causal Relations by Econometric Models and Cross-Spectral Method. **Econometrica Journal of Econometric Society 37: 424-438.**

Gujarati, Damodar N. 2003. **Basic econometrics.** 4thed. Singapore: McGraw-Hill

Hadri, Kaddour. 2000. **Testing for stationary in heterogeneous panel data.** Econometric Journal 3:148-161.

Hansen, L. 1982. **Large Sample Properties of Generalized Method of Moments Estimators.** Econometrica. 50, P. 1029-1054.

Im, K.S., Pesaran, M.H. and Shin, Y. 2003. **Testing for unit roots in heterogeneous panels.** Journal of Econometrics 115: 53-74.

Indiana University.2006. **Panel Data Models.** Available: http://www.indiana.edu/~statmath/stat/all/panel/panel3.html (March25,2012)

Kao, Chihwa. 1999. **Spurious regression and residual-based tests for cointegration in panel data.** Journal of Econometrics 90 (1):1-44.

Kao, c., M.H. Chiang, and B. Chen. 1999. **"International R&D spillover: An Application of Estimation and In ference in Panel Cointegration."** Oxford Bulletin of Economics and statistics61: 691-709

Maddala, G.S and Wu, S. 1999. "**A comparative study of unit root tests with panel data and a new simple test**" Oxford Bulletin of Economics and statistics 61:631-652

Levin, A., Lin, C.F. and Chu, C. 2002. **Unit root test in panel data: Asymptotic and finitesample properties.** Journal of Econometrics 108:1-24.

Luciano Gutierrez. 2003. "O n the power of panel cointegration tests: a Monte Carlo comparison." **Economics Letters** 80 :105–111

OECD Development Centre ,2010. **Asean Countries Returning to Pre-Crisis Growth** Available:http://www.oecd.org/document/2/0,3746,en_2649_33731_46367966_1_1_1_1, 00.html

Oscar Terres-Reyna. (No date). "**Panel data Analysis Fix & Random effects**" (online).Available:dss.princeton.edu/training/Panel101.pdf

Pedroni, p. 1999. Critical values for cointegration tests in heterogeneous panels with multiple regression. **Oxford Bulletin of Economics and Statistics, special Issue, p. 653-670.**

Pedroni, P. 2004. Panel cointegration: asymptotic and finite sample properties of pooled time series tests with an supplication to the PPP hypothesis: new results. Econometric Theory20 , 597-627

Philiips,P.C.B., Moon,H., 1999. Linear regression limit theory for nonstationary panel data. Econometric67, 1057-1111.

Verbeek, Marno. 2004. A **guide to modern econometrics.** 2nd ed. West Sussex: John Wiley & Sons.

World Bank, **General government final consumption expenditure.** 2009. Retrieved January 15, 2012Available: http://data.worldbank.org/data-catalog/world-development-indicators

World Bank, **Gross Domestic Product.** 2009. Retrieved January 15, 2012 Available:http://data.worldbank.org/indicator/NY.GDP.MKTP.CD.

ภาคผนวก

ภาคผนวก ก

ผลการทดสอบพาแนลยูนิทรูท (Panel Unit Root Test)

ตารางภาคผนวกที่ 1 ก ผลการทดสอบพาแนลยูนิทรูทของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ Level ($I(0)$) โดยกำหนดให้มีค่าคงที่ (Individual Intercept)

Panel unit root test: Summary
Series: LNGDP
Date: 05/02/12 Time: 12:03
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: Individual effects
Automatic selection of maximum lags
Automatic lag length selection based on SIC: 0 to 1
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel

Method	Statistic	Prob.**	Cross-sections	Obs
Null: Unit root (assumes common unit root process)				
Levin, Lin & Chu t*	-0.26761	0.3945	4	114
Null: Unit root (assumes individual unit root process)				
Im, Pesaran and Shin W-stat	2.13327	0.9835	4	114
ADF - Fisher Chi-square	1.49174	0.9928	4	114
PP - Fisher Chi-square	1.46343	0.9933	4	116

** Probabilities for Fisher tests are computed using an asymptotic Chi -square distribution. All other tests assume asymptotic normality.

Null Hypothesis: Stationarity
Series: LNGDP
Date: 05/02/12 Time: 12:04
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: Individual effects
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel
Total (balanced) observations: 120
Cross-sections included: 4

Method	Statistic	Prob.**
Hadri Z-stat	6.82218	0.0000
Heteroscedastic Consistent Z-stat	6.75654	0.0000

* Note: High autocorrelation leads to severe size distortion in Hadri test, leading to over-rejection of the null.
** Probabilities are computed assuming asympotic normality

ตารางภาคผนวกที่ 2 ก ผลการทดสอบพาแนลยูนิทรูทของงบประมาณค่าใช้จ่ายของรัฐบาลของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ Level ($I(0)$) โดยกำหนดให้มีค่าคงที่ (Individual Intercept)

Panel unit root test: Summary
Series: LNGOV
Date: 05/02/12 Time: 12:05
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: Individual effects
Automatic selection of maximum lags
Automatic lag length selection based on SIC: 0 to 1
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel

Method	Statistic	Prob.**	Cross-sections	Obs
Null: Unit root (assumes common unit root process)				
Levin, Lin & Chu t*	-0.42005	0.3372	4	115
Null: Unit root (assumes individual unit root process)				
Im, Pesaran and Shin W-stat	2.47941	0.9934	4	115
ADF - Fisher Chi-square	1.79485	0.9867	4	115
PP - Fisher Chi-square	2.26030	0.9720	4	116

** Probabilities for Fisher tests are computed using an asymptotic Chi -square distribution. All other tests assume asymptotic normality.

Null Hypothesis: Stationarity
Series: LNGOV
Date: 05/02/12 Time: 12:07
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: Individual effects
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel
Total (balanced) observations: 120
Cross-sections included: 4

Method	Statistic	Prob.**
Hadri Z-stat	6.80329	0.0000
Heteroscedastic Consistent Z-stat	6.52014	0.0000

* Note: High autocorrelation leads to severe size distortion in Hadri test, leading to over-rejection of the null.
** Probabilities are computed assuming asympotic normality

ตารางภาคผนวกที่ 3 ก ผลการทดสอบพาแนลยูนิทรูทของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ First differential $I(1)$) โดยกำหนดให้มีค่าคงที่ (Individual Intercept)

Panel unit root test: Summary
Series: D(LNGDP)
Date: 05/02/12 Time: 12:08
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: Individual effects
Automatic selection of maximum lags
Automatic lag length selection based on SIC: 0
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel
Balanced observations for each test

Method	Statistic	Prob.**	Cross-sections	Obs
Null: Unit root (assumes common unit root process)				
Levin, Lin & Chu t*	-5.17399	0.0000	4	112
Null: Unit root (assumes individual unit root process)				
Im, Pesaran and Shin W-stat	-5.25897	0.0000	4	112
ADF - Fisher Chi-square	41.6432	0.0000	4	112
PP - Fisher Chi-square	40.9922	0.0000	4	112

** Probabilities for Fisher tests are computed using an asymptotic Chi -square distribution. All other tests assume asymptotic normality.

Null Hypothesis: Stationarity
Series: D(LNGDP)
Date: 05/02/12 Time: 12:10
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: Individual effects
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel
Total (balanced) observations: 116
Cross-sections included: 4

Method	Statistic	Prob.**
Hadri Z-stat	-0.69276	0.7558
Heteroscedastic Consistent Z-stat	-0.77872	0.7819

* Note: High autocorrelation leads to severe size distortion in Hadri test, leading to over-rejection of the null.
** Probabilities are computed assuming asympotic normality

ตารางภาคผนวกที่ 4 ก ผลการทดสอบพาแนลยูนิทรูทของงบประมาณค่าใช้จ่ายของรัฐบาลของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ First Differential ($I(1)$) โดยกำหนดให้มีค่าคงที่ (Individual Intercept)

Panel unit root test: Summary
Series: D(LNGOV)
Date: 05/02/12 Time: 12:12
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: Individual effects
Automatic selection of maximum lags
Automatic lag length selection based on SIC: 0
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel
Balanced observations for each test

Method	Statistic	Prob.**	Cross-sections	Obs
Null: Unit root (assumes common unit root process)				
Levin, Lin & Chu t*	-7.27367	0.0000	4	112
Null: Unit root (assumes individual unit root process)				
Im, Pesaran and Shin W-stat	-6.55483	0.0000	4	112
ADF - Fisher Chi-square	52.1726	0.0000	4	112
PP - Fisher Chi-square	52.0008	0.0000	4	112

** Probabilities for Fisher tests are computed using an asymptotic Chi -square distribution. All other tests assume asymptotic normality.

Null Hypothesis: Stationarity
Series: D(LNGOV)
Date: 05/02/12 Time: 12:13
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: Individual effects
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel
Total (balanced) observations: 116
Cross-sections included: 4

Method	Statistic	Prob.**
Hadri Z-stat	0.02625	0.4895
Heteroscedastic Consistent Z-stat	-0.06800	0.5271

* Note: High autocorrelation leads to severe size distortion in Hadri test, leading to over-rejection of the null.
** Probabilities are computed assuming asympotic normality

ตารางภาคผนวกที่ 5 ก ผลการทดสอบพาแนลยูนิทรูทของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ Level ($I(0)$) โดยกำหนดให้มีค่าคงที่ และแนวโน้มเวลา (Individual Intercept and Trend)

Panel unit root test: Summary
Series: LNGDP
Date: 04/28/12 Time: 14:39
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: Individual effects, individual linear trends
Automatic selection of maximum lags
Automatic lag length selection based on SIC: 0 to 1
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel

Method	Statistic	Prob.**	Cross-sections	Obs
Null: Unit root (assumes common unit root process)				
Levin, Lin & Chu t*	0.21568	0.5854	4	114
Breitung t-stat	-0.20073	0.4205	4	110
Null: Unit root (assumes individual unit root process)				
Im, Pesaran and Shin W-stat	0.22120	0.5875	4	114
ADF - Fisher Chi-square	5.07266	0.7498	4	114
PP - Fisher Chi-square	4.34902	0.8243	4	116

** Probabilities for Fisher tests are computed using an asymptotic Chi -square distribution. All other tests assume asymptotic normality.

Null Hypothesis: Stationarity
Series: LNGDP
Date: 05/01/12 Time: 23:08
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: Individual effects, individual linear trends
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel
Total (balanced) observations: 120
Cross-sections included: 4

Method	Statistic	Prob.**
Hadri Z-stat	1.96835	0.0245
Heteroscedastic Consistent Z-stat	1.56121	0.0592

* Note: High autocorrelation leads to severe size distortion in Hadri test, leading to over-rejection of the null.
** Probabilities are computed assuming asympotic normality

ตารางภาคผนวกที่ 6 ก ผลการทดสอบพาแนลยูนิทรูทของงบประมาณค่าใช้จ่ายของรัฐบาลของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ Level ($I(0)$) โดยกำหนดให้มีค่าคงที่ และแนวโน้มเวลา (Individual Intercept and Trend)

Panel unit root test: Summary
Series: LNGOV
Date: 05/01/12 Time: 23:56
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: Individual effects, individual linear trends
Automatic selection of maximum lags
Automatic lag length selection based on SIC: 0 to 3
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel

Method	Statistic	Prob.**	Cross-sections	Obs
Null: Unit root (assumes common unit root process)				
Levin, Lin & Chu t*	-0.09172	0.4635	4	113
Breitung t-stat	-0.64896	0.2582	4	109
Null: Unit root (assumes individual unit root process)				
Im, Pesaran and Shin W-stat	-0.16945	0.4327	4	113
ADF - Fisher Chi-square	8.17144	0.4169	4	113
PP - Fisher Chi-square	3.96562	0.8602	4	116

** Probabilities for Fisher tests are computed using an asymptotic Chi -square distribution. All other tests assume asymptotic normality.

Null Hypothesis: Stationarity
Series: LNGOV
Date: 05/02/12 Time: 00:04
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: Individual effects, individual linear trends
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel
Total (balanced) observations: 120
Cross-sections included: 4

Method	Statistic	Prob.**
Hadri Z-stat	2.52000	0.0059
Heteroscedastic Consistent Z-stat	2.28569	0.0111

* Note: High autocorrelation leads to severe size distortion in Hadri test, leading to over-rejection of the null.
** Probabilities are computed assuming asympotic normality

ตารางภาคผนวกที่ 7 ก ผลการทดสอบพาแนลยูนิทรูทของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ First differential *I*(1))โดยกำหนดให้มีค่าคงที่ และแนวโน้มเวลา (Individual Intercept and Trend)

Panel unit root test: Summary
Series: D(LNGDP)
Date: 05/02/12 Time: 00:11
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: Individual effects, individual linear trends
Automatic selection of maximum lags
Automatic lag length selection based on SIC: 0
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel
Balanced observations for each test

Method	Statistic	Prob.**	Cross-sections	Obs
Null: Unit root (assumes common unit root process)				
Levin, Lin & Chu t*	-3.35135	0.0004	3	84
Breitung t-stat	-3.86127	0.0001	3	81
Null: Unit root (assumes individual unit root process)				
Im, Pesaran and Shin W-stat	-3.44420	0.0003	3	84
ADF - Fisher Chi-square	22.4694	0.0010	3	84
PP - Fisher Chi-square	23.0533	0.0008	3	84

** Probabilities for Fisher tests are computed using an asymptotic Chi -square distribution. All other tests assume asymptotic normality.

Null Hypothesis: Stationarity
Series: D(LNGDP)
Date: 05/02/12 Time: 00:12
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: Individual effects, individual linear trends
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel
Total (balanced) observations: 116
Cross-sections included: 4

Method	Statistic	Prob.**
Hadri Z-stat	0.23438	0.4073
Heteroscedastic Consistent Z-stat	0.24075	0.4049

* Note: High autocorrelation leads to severe size distortion in Hadri test, leading to over-rejection of the null.
** Probabilities are computed assuming asympotic normality

ตารางภาคผนวกที่ 8 ก ผลการทดสอบพาแนลยูนิทรูทของงบประมาณค่าใช้จ่ายของรัฐบาลของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ First Differential ($I(1)$) โดยกำหนดให้มีค่าคงที่ และแนวโน้มเวลา (Individual Intercept and Trend)

Panel unit root test: Summary
Series: D(LNGOV)
Date: 05/02/12 Time: 00:14
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: Individual effects, individual linear trends
Automatic selection of maximum lags
Automatic lag length selection based on SIC: 0
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel
Balanced observations for each test

Method	Statistic	Prob.**	Cross-sections	Obs
Null: Unit root (assumes common unit root process)				
Levin, Lin & Chu t*	-5.28928	0.0000	3	84
Breitung t-stat	-4.84965	0.0000	3	81
Null: Unit root (assumes individual unit root process)				
Im, Pesaran and Shin W-stat	-4.80488	0.0000	3	84
ADF - Fisher Chi-square	30.6083	0.0000	3	84
PP - Fisher Chi-square	31.0719	0.0000	3	84

** Probabilities for Fisher tests are computed using an asymptotic Chi -square distribution. All other tests assume asymptotic normality.

Null Hypothesis: Stationarity
Series: D(LNGOV)
Date: 05/02/12 Time: 00:15
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: Individual effects
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel
Total (balanced) observations: 116
Cross-sections included: 4

Method	Statistic	Prob.**
Hadri Z-stat	0.02625	0.4895
Heteroscedastic Consistent Z-stat	-0.06800	0.5271

* Note: High autocorrelation leads to severe size distortion in Hadri test, leading to over-rejection of the null.
** Probabilities are computed assuming asympotic normality

ตารางภาคผนวกที่ 9 ก ผลการทดสอบพาแนลยูนิทรูทของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ Level ($I(0)$) โดยกำหนดให้ไม่มีค่าคงที่และแนวโน้มเวลา (None)

Panel unit root test: Summary
Series: LNGDP
Date: 05/02/12 Time: 12:29
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: None
Automatic selection of maximum lags
Automatic lag length selection based on SIC: 0 to 1
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel

Method	Statistic	Prob.**	Cross-sections	Obs
Null: Unit root (assumes common unit root process)				
Levin, Lin & Chu t*	4.24668	1.0000	4	114
Null: Unit root (assumes individual unit root process)				
ADF - Fisher Chi-square	0.14331	1.0000	4	114
PP - Fisher Chi-square	0.04633	1.0000	4	116

** Probabilities for Fisher tests are computed using an asymptotic Chi -square distribution. All other tests assume asymptotic normality.

ตารางภาคผนวกที่ 10 ก ผลการทดสอบพาแนลยูนิทรูทของงบประมาณค่าใช้จ่ายของรัฐบาลของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ Level ($I(0)$) โดยกำหนดให้ไม่มีค่าคงที่และแนวโน้มเวลา (None)

Panel unit root test: Summary
Series: LNGOV
Date: 05/02/12 Time: 13:06
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: None
Automatic selection of maximum lags
Automatic lag length selection based on SIC: 0 to 1
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel

Method	Statistic	Prob.**	Cross-sections	Obs
Null: Unit root (assumes common unit root process)				
Levin, Lin & Chu t*	6.80697	1.0000	4	115
Null: Unit root (assumes individual unit root process)				
ADF - Fisher Chi-square	0.14305	1.0000	4	115
PP - Fisher Chi-square	0.09969	1.0000	4	116

** Probabilities for Fisher tests are computed using an asymptotic Chi -square distribution. All other tests assume asymptotic normality.

ตารางภาคผนวกที่ 11ก ผลการทดสอบพาแนลยูนิทรูทของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ First differential $I(1)$) โดยกำหนดให้ไม่มีค่าคงที่และแนวโน้มเวลา (None)

Panel unit root test: Summary
Series: D(LNGDP)
Date: 05/02/12 Time: 13:09
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: None
Automatic selection of maximum lags
Automatic lag length selection based on SIC: 0
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel
Balanced observations for each test

Method	Statistic	Prob.**	Cross-sections	Obs
Null: Unit root (assumes common unit root process)				
Levin, Lin & Chu t*	-5.67325	0.0000	3	84
Null: Unit root (assumes individual unit root process)				
ADF - Fisher Chi-square	42.9773	0.0000	3	84
PP - Fisher Chi-square	42.9629	0.0000	3	84

** Probabilities for Fisher tests are computed using an asymptotic Chi -square distribution. All other tests assume asymptotic normality.

ตารางภาคผนวกที่12 ก ผลการทดสอบพาแนลยูนิทรูทของงบประมาณค่าใช้จ่ายของรัฐบาลของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ First Differential ($I(1)$) โดยกำหนดให้ไม่มีค่าคงที่และแนวโน้มเวลา (None)

Panel unit root test: Summary
Series: D(LNGOV)
Date: 05/02/12 Time: 13:11
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: None
Automatic selection of maximum lags
Automatic lag length selection based on SIC: 0
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel
Balanced observations for each test

Method	Statistic	Prob.**	Cross-sections	Obs
Null: Unit root (assumes common unit root process)				
Levin, Lin & Chu t*	-6.03447	0.0000	3	84
Null: Unit root (assumes individual unit root process)				
ADF - Fisher Chi-square	47.5408	0.0000	3	84
PP - Fisher Chi-square	46.8480	0.0000	3	84

** Probabilities for Fisher tests are computed using an asymptotic Chi -square distribution. All other tests assume asymptotic normality.

ภาคผนวก ข

ผลการทดสอบพาแนลโคอินทิเกรชัน (Panel Cointegration Test)

ตารางภาคผนวกที่1 ข ผลการทดสอบพาแนลโคอินทิเกรชันของแบบจำลองความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ด้วยวิธี Pedroni with intercept

Pedroni Residual Cointegration Test
Series: LNGDP LNGOV
Date: 05/02/12 Time: 01:00
Sample: 1980 2009
Included observations: 120
Cross-sections included: 4
Null Hypothesis: No cointegration
Trend assumption: No deterministic trend
Automatic lag length selection based on SIC with a max lag of 6
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel

Alternative hypothesis: common AR coefs. (within-dimension)

	Statistic	Prob.	Weighted Statistic	Prob.
Panel v-Statistic	0.191173	0.4242	-0.056938	0.5227
Panel rho-Statistic	0.274384	0.6081	0.408065	0.6584
Panel PP-Statistic	0.272771	0.6075	0.405768	0.6575
Panel ADF-Statistic	0.244950	0.5968	0.335929	0.6315

Alternative hypothesis: individual AR coefs. (between-dimension)

	Statistic	Prob.
Group rho-Statistic	1.144014	0.8737
Group PP-Statistic	1.030142	0.8485
Group ADF-Statistic	0.885775	0.8121

Cross section specific results

Phillips-Peron results (non-parametric)

Cross ID	AR(1)	Variance	HAC	Bandwidth	Obs
1	0.872	0.006455	0.006544	2.00	29
2	0.813	0.006172	0.006237	4.00	29
3	0.949	0.002378	0.004493	3.00	29
4	0.759	0.005775	0.007024	2.00	29

Augmented Dickey-Fuller results (parametric)

Cross ID	AR(1)	Variance	Lag	Max lag	Obs
1	0.872	0.006455	0	6	29
2	0.813	0.006172	0	6	29
3	0.878	0.001714	1	6	28
4	0.759	0.005775	0	6	29

ตารางภาคผนวกที่2 ข ผลการทดสอบพาแนลโคอินทิเกรชันของแบบจำลองความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ด้วยวิธี Pedroni with intercept and trend

Pedroni Residual Cointegration Test
Series: LNGDP LNGOV
Date: 05/02/12 Time: 01:08
Sample: 1980 2009
Included observations: 120
Cross-sections included: 4
Null Hypothesis: No cointegration
Trend assumption: Deterministic intercept and trend
User-specified lag length: 1
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel

Alternative hypothesis: common AR coefs. (within-dimension)

	Statistic	Prob.	Weighted Statistic	Prob.
Panel v-Statistic	-0.006060	0.5024	-0.060609	0.5242
Panel rho-Statistic	0.566346	0.7144	0.754074	0.7746
Panel PP-Statistic	0.367638	0.6434	0.671670	0.7491
Panel ADF-Statistic	-0.302233	0.3812	0.015782	0.5063

Alternative hypothesis: individual AR coefs. (between-dimension)

	Statistic	Prob.
Group rho-Statistic	1.365791	0.9140
Group PP-Statistic	1.155208	0.8760
Group ADF-Statistic	0.426783	0.6652

Cross section specific results

Phillips-Peron results (non-parametric)

Cross ID	AR(1)	Variance	HAC	Bandwidth	Obs
1	0.725	0.002746	0.003128	1.00	29
2	0.736	0.004356	0.004659	2.00	29
3	0.943	0.002525	0.004764	3.00	29
4	0.583	0.007242	0.007242	0.00	29

Augmented Dickey-Fuller results (parametric)

Cross ID	AR(1)	Variance	Lag	Max lag	Obs
1	0.668	0.002724	1	--	28
2	0.686	0.004115	1	--	28
3	0.862	0.001829	1	--	28
4	0.482	0.007042	1	--	28

ตารางภาคผนวกที่3 ข ผลการทดสอบพาแนลโคอินทิเกรชันของแบบจำลองความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ด้วยวิธี Pedroni with none

Pedroni Residual Cointegration Test
Series: LNGDP LNGOV
Date: 05/02/12 Time: 01:12
Sample: 1980 2009
Included observations: 120
Cross-sections included: 4
Null Hypothesis: No cointegration
Trend assumption: No deterministic intercept or trend
Automatic lag length selection based on SIC with a max lag of 6
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel

Alternative hypothesis: common AR coefs. (within-dimension)

	Statistic	Prob.	Weighted Statistic	Prob.
Panel v-Statistic	1.654232	0.0490	1.394364	0.0816
Panel rho-Statistic	-0.879243	0.1896	-0.778124	0.2182
Panel PP-Statistic	-0.808950	0.2093	-0.695156	0.2435
Panel ADF-Statistic	-0.893115	0.1859	-0.792727	0.2140

Alternative hypothesis: individual AR coefs. (between-dimension)

	Statistic	Prob.
Group rho-Statistic	0.762924	0.7772
Group PP-Statistic	-0.172489	0.4315
Group ADF-Statistic	-0.293623	0.3845

Cross section specific results

Phillips-Peron results (non-parametric)

Cross ID	AR(1)	Variance	HAC	Bandwidth	Obs
1	0.854	0.009943	0.010199	2.00	29
2	0.814	0.005617	0.005272	5.00	29
3	1.002	0.002566	0.004849	3.00	29
4	0.785	0.006399	0.007085	1.00	29

Augmented Dickey-Fuller results (parametric)

Cross ID	AR(1)	Variance	Lag	Max lag	Obs
1	0.854	0.009943	0	6	29
2	0.814	0.005617	0	6	29
3	0.920	0.001912	1	6	28
4	0.785	0.006399	0	6	29

ตารางภาคผนวกที่4 ข ผลการทดสอบพาแนลโคอินทิเกรชันของแบบจำลองความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ด้วยวิธี Kao

Kao Residual Cointegration Test
Series: LNGOV LNGDP
Date: 05/02/12 Time: 01:16
Sample: 1980 2009
Included observations: 120
Null Hypothesis: No cointegration
Trend assumption: No deterministic trend
Automatic lag length selection based on SIC with a max lag of 7
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel

	t-Statistic	Prob.
ADF	-2.254470	0.0121
Residual variance	0.005253	
HAC variance	0.005477	

Augmented Dickey-Fuller Test Equation
Dependent Variable: D(RESID)
Method: Least Squares
Date: 05/02/12 Time: 01:16
Sample (adjusted): 1981 2009
Included observations: 116 after adjustments

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
RESID(-1)	-0.148426	0.052177	-2.844651	0.0053

R-squared	0.060735	Mean dependent var	0.005366
Adjusted R-squared	0.060735	S.D. dependent var	0.073632
S.E. of regression	0.071361	Akaike info criterion	-2.433537
Sum squared resid	0.585631	Schwarz criterion	-2.409799
Log likelihood	142.1452	Hannan-Quinn criter.	-2.423901
Durbin-Watson stat	1.710510		

ภาคผนวก ค

ผลการทดสอบสมการพาแนล (Panel Equation Testing)

ตารางภาคผนวกที่ 1 ค ผลการทดสอบสมการพาแนลด้วยวิธี Redundant Fixed Effects Test

Redundant Fixed Effects Tests
Equation: Untitled
Test cross-section and period fixed effects

Effects Test	Statistic	d.f.	Prob.
Cross-section F	208.295899	(3,86)	0.0000
Cross-section Chi-square	253.460061	3	0.0000
Period F	11.753766	(29,86)	0.0000
Period Chi-square	192.252831	29	0.0000
Cross-Section/Period F	27.011027	(32,86)	0.0000
Cross-Section/Period Chi-square	288.298328	32	0.0000

Cross-section fixed effects test equation:
Dependent Variable: LNGDP
Method: Panel Least Squares
Date: 05/21/12 Time: 14:45
Sample: 1980 2009
Periods included: 30
Cross-sections included: 4
Total panel (balanced) observations: 120

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
LNGOV	1.023991	0.047795	21.42470	0.0000
C	1.686962	1.096785	1.538098	0.1276

Effects Specification

Period fixed (dummy variables)

R-squared	0.950743	Mean dependent var	25.18181
Adjusted R-squared	0.934140	S.D. dependent var	0.801030
S.E. of regression	0.205570	Akaike info criterion	-0.108251
Sum squared resid	3.761044	Schwarz criterion	0.611851
Log likelihood	37.49508	Hannan-Quinn criter.	0.184185
F-statistic	57.26223	Durbin-Watson stat	0.086841
Prob(F-statistic)	0.000000		

ตารางภาคผนวกที่ 2ค ผลการทดสอบสมการพาแนลด้วยวิธี Huasman Test

Correlated Random Effects - Hausman Test
Equation: Untitled
Test cross-section and period random effects

Test Summary	Chi-Sq. Statistic	Chi-Sq. d.f.	Prob.
Cross-section random	0.000000	1	1.0000
Period random	118.574001	1	0.0000
Cross-section and period random	119.576477	1	0.0000

* Cross-section test variance is invalid. Hausman statistic set to zero.

Cross-section random effects test comparisons:

Variable	Fixed	Random	Var(Diff.)	Prob.
LNGOV	0.902983	0.904162	-0.000248	NA

Cross-section random effects test equation:
Dependent Variable: LNGDP
Method: Panel EGLS (Period random effects)
Date: 05/21/12 Time: 14:33
Sample: 1980 2009
Periods included: 30
Cross-sections included: 4
Total panel (balanced) observations: 120
Swamy and Arora estimator of component variances

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	4.463415	0.511687	8.722931	0.0000
LNGOV	0.902983	0.022299	40.49374	0.0000

Effects Specification	S.D.	Rho
Cross-section fixed (dummy variables)		
Period random	0.098441	0.6469
Idiosyncratic random	0.072737	0.3531

Weighted Statistics

R-squared	0.968650	Mean dependent var	25.18181
Adjusted R-squared	0.967559	S.D. dependent var	0.498295
S.E. of regression	0.089750	Sum squared resid	0.926322
F-statistic	888.3063	Durbin-Watson stat	0.303681
Prob(F-statistic)	0.000000		

ตารางภาคผนวกที่3 ค ผลการทดสอบสมการพาแนลด้วยวิธี Lagrange Multipier Test (LM-Test)

```
. xtreg lngdp lngov, re

Random-effects GLS regression                   Number of obs      =       120
Group variable: id                              Number of groups   =         4

R-sq:  within  = 0.9600                         Obs per group: min =        30
       between = 0.8668                                        avg =      30.0
       overall = 0.9342                                        max =         3

Random effects u_i ~ Gaussian                   Wald chi2(1)       =   2791.57
corr(u_i, X)       = 0 (assumed)                Prob > chi2        =    0.0000

------------------------------------------------------------------------------
       lngdp |      Coef.   Std. Err.      z    P>|z|     [95% Conf. Interval]
-------------+----------------------------------------------------------------
       lngov |   1.038572   .0196568    52.84   0.000     1.000045    1.077098
       _cons |   1.352423   .4630337     2.92   0.003     .4448939    2.259952
-------------+----------------------------------------------------------------
     sigma_u |  .20888654
     sigma_e |  .14013521
         rho |  .68962506   (fraction of variance due to u_i)
------------------------------------------------------------------------------
. xttest0

Breusch and Pagan Lagrangian multiplier test for random effects

        lngdp[id,t] = Xb + u[id] + e[id,t]

        Estimated results:
                         |       Var     sd = sqrt(Var)
                ---------+-----------------------------
                   lngdp |   .6416492        .8010301
                       e |   .0196379        .1401352
                       u |   .0436336        .2088865

        Test:   Var(u) = 0
                                 chi2(1) =   489.74
                              Prob > chi2 =   0.0000
```

ภาคผนวก ง

ผลการประมาณค่าแบบจำลองพาแนล (Panel Estimation)

ตารางภาคผนวกที่ 1ง ผลการประมาณความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ แบบ Cross-section Random Effects ด้วยวิธี OLS-Estimator

Dependent Variable: LNGDP
Method: Panel EGLS (Cross-section random effects)
Date: 05/10/12 Time: 12:57
Sample: 1980 2009
Periods included: 30
Cross-sections included: 4
Total panel (balanced) observations: 120
Swamy and Arora estimator of component variances

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
LNGOV	1.038572	0.019732	52.63494	0.0000
C	1.352422	0.464797	2.909706	0.0043

Effects Specification	S.D.	Rho
Cross-section random	0.208887	0.6896
Idiosyncratic random	0.140135	0.3104

Weighted Statistics

R-squared	0.959444	Mean dependent var	3.061467
Adjusted R-squared	0.959101	S.D. dependent var	0.690300
S.E. of regression	0.139604	Sum squared resid	2.299721
F-statistic	2791.576	Durbin-Watson stat	0.295437
Prob(F-statistic)	0.000000		

ตารางภาคผนวกที่ 2ง ผลการประมาณความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ แบบ Cross-section Random Effects ด้วยวิธี DOLS-Estimator

Dependent Variable: LNGDP
Method: Panel EGLS (Cross-section random effects)
Date: 05/10/12 Time: 21:41
Sample (adjusted): 1982 2009
Periods included: 28
Cross-sections included: 4
Total panel (balanced) observations: 112
Swamy and Arora estimator of component variances

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
LNGOV	1.038357	0.021674	47.90764	0.0000
C	1.370485	0.516381	2.654019	0.0091
D(LNGOV(-1))	-0.086951	0.086278	-1.007796	0.3158

Effects Specification	S.D.	Rho
Cross-section random	0.277273	0.8041
Idiosyncratic random	0.136837	0.1959

Weighted Statistics			
R-squared	0.957151	Mean dependent var	2.345215
Adjusted R-squared	0.956365	S.D. dependent var	0.649591
S.E. of regression	0.135693	Sum squared resid	2.006978
F-statistic	1217.412	Durbin-Watson stat	0.356532
Prob(F-statistic)	0.000000		

ตารางภาคผนวกที่ 3ง ผลการประมาณความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ แบบ Cross-section Fixed Effects ด้วยวิธี GMM-Estimator

Dependent Variable: LNGDP
Method: Panel GMM EGLS (Cross-section random effects)
Date: 05/10/12 Time: 21:51
Sample (adjusted): 1981 2009
Periods included: 29
Cross-sections included: 4
Total panel (balanced) observations: 116
2SLS instrument weighting matrix
Swamy and Arora estimator of component variances
Instrument specification: LNGDP(-1) LNGOV(-1) C

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
LNGOV	1.052233	0.021328	49.33519	0.0000
C	1.040915	0.501061	2.077420	0.0400

Effects Specification	S.D.	Rho
Cross-section random	0.207046	0.6853
Idiosyncratic random	0.140310	0.3147

Weighted Statistics

R-squared	0.956757	Mean dependent var	3.148743
Adjusted R-squared	0.956378	S.D. dependent var	0.669430
S.E. of regression	0.139817	Sum squared resid	2.228562
Durbin-Watson stat	0.307865	J-statistic	81.86023
Instrument rank	3		

ตารางภาคผนวกที่ 4ง ผลการประมาณความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ แบบ Cross-section Fixed Effects ด้วยวิธี OLS-Estimator แบบ Random Effect รายประเทศ

Country	Effect
Indonesia	0.203689
Malaysia	-0.205043
Thai	-0.058493
Singapore	0.059847

ตารางภาคผนวกที่ 5ง ผลการประมาณความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ แบบ Cross-section Fixed Effects ด้วยวิธี DOLS-Estimator แบบ Random Effect รายประเทศ

Country	Effect
Indonesia	0.212449
Malaysia	-0.198415
Thai	-0.060269
Singapore	0.046235

ตารางภาคผนวกที่ 6ง ผลการประมาณความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ แบบ Cross-section Fixed Effects ด้วยวิธี GMM-Estimator แบบ Random Effect รายประเทศ

Country	Effect
Indonesia	0.202727
Malaysia	-0.200914
Thai	-0.061704
Singapore	0.059891

ภาคผนวก จ

ผลการหาความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะสั้นด้วยวิธี OLS-Estimateor

ตารางภาคผนวกที่1จ ผลการหาความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะสั้นด้วยวิธี OLS-Estimator

Dependent Variable: D(LNGDP)
Method: Panel EGLS (Cross-section random effects)
Date: 05/10/12 Time: 18:06
Sample (adjusted): 1981 2009
Periods included: 29
Cross-sections included: 4
Total panel (balanced) observations: 116
Swamy and Arora estimator of component variances

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.017622	0.006577	2.679469	0.0085
D(LNGOV)	0.775610	0.038839	19.96968	0.0000
ECMOLS(-1)	-0.045434	0.028911	-1.571524	0.1189

Effects Specification		
	S.D.	Rho
Cross-section random	0.000000	0.0000
Idiosyncratic random	0.063398	1.0000

Weighted Statistics

R-squared	0.779221	Mean dependent var	0.076228
Adjusted R-squared	0.775313	S.D. dependent var	0.133836
S.E. of regression	0.063440	Sum squared resid	0.454783
F-statistic	199.4118	Durbin-Watson stat	1.551593
Prob(F-statistic)	0.000000		

ตารางภาคผนวกที่2จ ผลการหาความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะสั้นด้วยวิธี DOLS-Estimator

Dependent Variable: D(LNGDP)
Method: Panel EGLS (Cross-section random effects)
Date: 05/10/12 Time: 18:16
Sample (adjusted): 1983 2009
Periods included: 27
Cross-sections included: 4
Total panel (balanced) observations: 108
Swamy and Arora estimator of component variances

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.011890	0.007582	1.568316	0.1198
D(LNGOV)	0.781147	0.039230	19.91189	0.0000
D(LNGOV(-1))	0.103945	0.047823	2.173547	0.0320
ECMDOLS(-1)	-0.058753	0.030596	-1.920317	0.0576

Effects Specification	S.D.	Rho
Cross-section random	0.000000	0.0000
Idiosyncratic random	0.063329	1.0000

Weighted Statistics

R-squared	0.791277	Mean dependent var	0.075324
Adjusted R-squared	0.785256	S.D. dependent var	0.137814
S.E. of regression	0.063864	Sum squared resid	0.424171
F-statistic	131.4227	Durbin-Watson stat	1.464284
Prob(F-statistic)	0.000000		

ตารางภาคผนวกที่ 3จ ผลการหาความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะสั้นด้วยวิธี GMM-Estimator

Dependent Variable: D(LNGDP)
Method: Panel GMM EGLS (Cross-section random effects)
Date: 05/10/12 Time: 17:59
Sample (adjusted): 1986 2009
Periods included: 24
Cross-sections included: 4
Total panel (balanced) observations: 96
2SLS instrument weighting matrix
Swamy and Arora estimator of component variances
Instrument specification: C LNGOV(-2) LNGOV(-3) LNGOV(-4) LNGOV(-5) LNGOV(-6)

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.014960	0.012463	1.200410	0.2330
D(LNGOV)	1.012282	0.146231	6.922470	0.0000
ECMGMM(-1)	-0.462224	0.154641	-2.989021	0.0036

Effects Specification	S.D.	Rho
Cross-section random	0.000000	0.0000
Idiosyncratic random	0.051223	1.0000

Weighted Statistics

R-squared	0.443884	Mean dependent var	0.081558
Adjusted R-squared	0.431925	S.D. dependent var	0.142279
S.E. of regression	0.107237	Sum squared resid	1.069481
Durbin-Watson stat	0.500598	J-statistic	2.913113
Instrument rank	6		

ภาคผนวก ฉ

ผลการประมาณค่าความสัมพันธ์ระยะยาวโดย

พิจารณาค่าความแตกต่างของผลกระทบในแต่ละประเทศ

ตารางภาคผนวกที่ 1ฉ ผลการประมาณความสัมพันธ์ระยะยาวระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาล กับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้

Dependent Variable: LNGDP
Method: Panel Least Squares
Date: 05/24/12 Time: 11:06
Sample: 1980 2009
Periods included: 30
Cross-sections included: 4
Total panel (balanced) observations: 120

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	2.053591	0.687278	2.988007	0.0035
D1	0.152811	1.290748	0.118390	0.9060
D2	-3.216014	1.229541	-2.615622	0.0101
D3	-0.426311	1.162838	-0.366613	0.7146
LNGOV	1.010021	0.030619	32.98682	0.0000
D1LNGOV	0.000795	0.055960	0.014211	0.9887
D2LNGOV	0.129307	0.054032	2.393181	0.0184
D3LNGOV	0.014103	0.050798	0.277625	0.7818

R-squared	0.972039	Mean dependent var	25.18181
Adjusted R-squared	0.970291	S.D. dependent var	0.801030
S.E. of regression	0.138068	Akaike info criterion	-1.057802
Sum squared resid	2.135027	Schwarz criterion	-0.871969
Log likelihood	71.46812	Hannan-Quinn criter.	-0.982334
F-statistic	556.2176	Durbin-Watson stat	0.314829
Prob(F-statistic)	0.000000		

ตารางภาคผนวกที่ 2ฉ ผลการทดสอบความนิ่งจากส่วนที่เหลือ(Residual)จากการประมาณความสัมพันธ์ระยะยาวระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้

Panel unit root test: Summary
Series: E
Date: 05/24/12 Time: 11:06
Sample: 1980 2009
Exogenous variables: None
User-specified lags: 1
Newey-West automatic bandwidth selection and Bartlett kernel
Balanced observations for each test

Method	Statistic	Prob.**	Cross-sections	Obs
Null: Unit root (assumes common unit root process)				
Levin, Lin & Chu t*	-3.44294	0.0003	4	112
Null: Unit root (assumes individual unit root process)				
ADF - Fisher Chi-square	21.9191	0.0051	4	112
PP - Fisher Chi-square	18.2672	0.0193	4	116

** Probabilities for Fisher tests are computed using an asymptotic Chi -square distribution. All other tests assume asymptotic normality.

สำนักงานคณะกรรมการวิจัยแห่งชาติ ห้องสมุดงานวิจัย

ประวัติผู้เขียน

ชื่อ-สกุล นางสาวธิดารัตน์ โกไศยกานนท์

วัน เดือน ปี เกิด 17 เมษายน 2532

ประวัติการศึกษา สำเร็จการศึกษามัธยมศึกษาตอนปลายโรงเรียนคณะราษฎรบำรุง
ปีการศึกษา 2549
สำเร็จการศึกษาปริญญาตรี เศรษฐศาสตรบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ ปีการศึกษา 2553