

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ก
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญ	ช
สารบัญตาราง	ญ
สารบัญตารางภาคผนวก	ฎ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	8
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา	8
1.4 ขอบเขตการศึกษา	9
1.5 นิยามศัพท์	10
บทที่ 2 แนวคิดทฤษฎีและเอกสารที่เกี่ยวข้อง	
2.1 แนวคิดและทฤษฎีทางเศรษฐศาสตร์	11
2.1.1 ทฤษฎีการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของ The Solow growth model	11
2.1.2 ทฤษฎีเกี่ยวกับการใช้จ่ายภาครัฐบาล	15
2.2 แนวคิดและทฤษฎีทางเศรษฐมิติ	18
2.2.1 ข้อมูลพาแนล	19
2.2.2 การทดสอบพาแนลยูนิทรูท	20
2.2.3 แบบจำลองพาแนล	27
2.2.4 การทดสอบสมการพาแนล	34
2.2.5 การประมาณแบบจำลองพาแนล	37
2.2.6 การทดสอบพาแนลโคอินทิเกรชัน	38
2.2.7 การหาความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะสั้น	41
2.2.8 การทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล	42

2.3 เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	42
บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย	
3.1 แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา	48
3.2 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	52
3.3 วิธีการวิจัย	52
3.3.1 การทดสอบพหุแนลยูนิทรูท	53
3.3.2 การทดสอบพหุแนล โคอินทิเกรชัน	55
3.3.3 การประมาณค่าแบบจำลองพหุแนล	56
3.3.4 การหาความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะสั้น	61
3.3.5 การทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล	61
บทที่ 4 ผลการศึกษา	
4.1 ผลการทดสอบพหุแนลยูนิทรูท	64
4.2 ผลการทดสอบพหุแนล โคอินทิเกรชัน	65
4.3 ผลการทดสอบสมการพหุแนล	67
4.4 ผลการประมาณค่าแบบจำลองพหุแนล	70
4.5 ผลการหาความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะสั้น	73
4.6 ผลการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล	76
บทที่ 5 สรุปผลและข้อเสนอแนะ	
5.1 สรุปผลการศึกษา	80
5.2 ข้อเสนอแนะ	83
5.3 ข้อเสนอแนะในการศึกษาครั้งต่อไป	84
เอกสารอ้างอิง	85
ภาคผนวก	
ภาคผนวก ก ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	89
ภาคผนวก ข ผลการคำนวณจากโปรแกรม	93
ประวัติผู้เขียน	118

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
1.1	6
มูลผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศการใช้จ่ายของภาครัฐบาลและร้อยละ	
การเปลี่ยนแปลงของกลุ่มประเทศ GMS ยกเว้นพม่า ปี พ.ศ.2549 ถึงปี พ.ศ.2553	
2.1	33
ความแตกต่างระหว่างการประมาณแบบ Pooled OLS, Fixed Effects และแบบ	
Random Effects	
2.2	45
สรุปเอกสารและงานวิจัยการศึกษาการใช้จ่ายของภาครัฐบาลและการเจริญเติบโต	
ทางเศรษฐกิจ	
4.1	64
ผลการทดสอบพหุสมการพหุคูณ: 5 ประเทศ โดยใช้แบบ Intercept ของกลุ่มประเทศ	
ในอนุภูมิภาคแม่น้ำโขง (GMS)	
4.2	66
ผลการทดสอบพหุสมการพหุคูณด้วยวิธีของ Pedroni และ Kao Residual	
Cointegration Test	
4.3	68
ผลการทดสอบสมการพหุคูณด้วยวิธีของ Hausman Test: ระหว่างตัวแปรตาม	
$\ln(\text{GDP})_{it}$ และตัวแปรอิสระ $\ln(\text{Gt})_{it}$	
4.4	68
ผลการทดสอบสมการพหุคูณด้วยวิธี Redundant Fixed Effects Test: ระหว่าง	
ตัวแปรตาม $\ln(\text{GDP})_{it}$ และตัวแปรอิสระ $\ln(\text{Gt})_{it}$	
4.5	69
ผลการทดสอบสมการพหุคูณด้วยวิธีของ Hausman Test: ระหว่างตัวแปรตาม	
$\ln(\text{GDP})_{it}$ และตัวแปรอิสระ $\ln(\text{Gi})_{it}$	
4.6	70
ผลการทดสอบสมการพหุคูณด้วยวิธี Redundant Fixed Effects Test: ระหว่าง	
ตัวแปรตาม $\ln(\text{GDP})_{it}$ และตัวแปรอิสระ $\ln(\text{Gi})_{it}$	
4.7	71
ผลการประมาณค่าความสัมพันธ์ระหว่างตัวแปรผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ	
$\ln(\text{GDP})_{it}$ และการใช้จ่ายรวมของภาครัฐบาล $\ln(\text{Gt})_{it}$ ของกลุ่มประเทศ GMS	
ด้วยวิธี OLS-Estimator, DOLS-Estimator และ GMM-Estimator	
4.8	72
ผลการประมาณค่าความสัมพันธ์ระหว่างตัวแปรผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ	
$\ln(\text{GDP})_{it}$ และการใช้จ่ายของภาครัฐบาลเพื่อการลงทุน $\ln(\text{Gi})_{it}$ ของกลุ่มประเทศ	
GMS ด้วยวิธี OLS-Estimator, DOLS-Estimator และ GMM-Estimator	
4.9	74
ผลการทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะสั้นด้วยวิธีของ (Error Correction	
Mechanism: ECM) ระหว่างตัวแปร $\ln(\text{GDP})_{it}$ กับ $\ln(\text{Gt})_{it}$ ของกลุ่มประเทศ GMS	

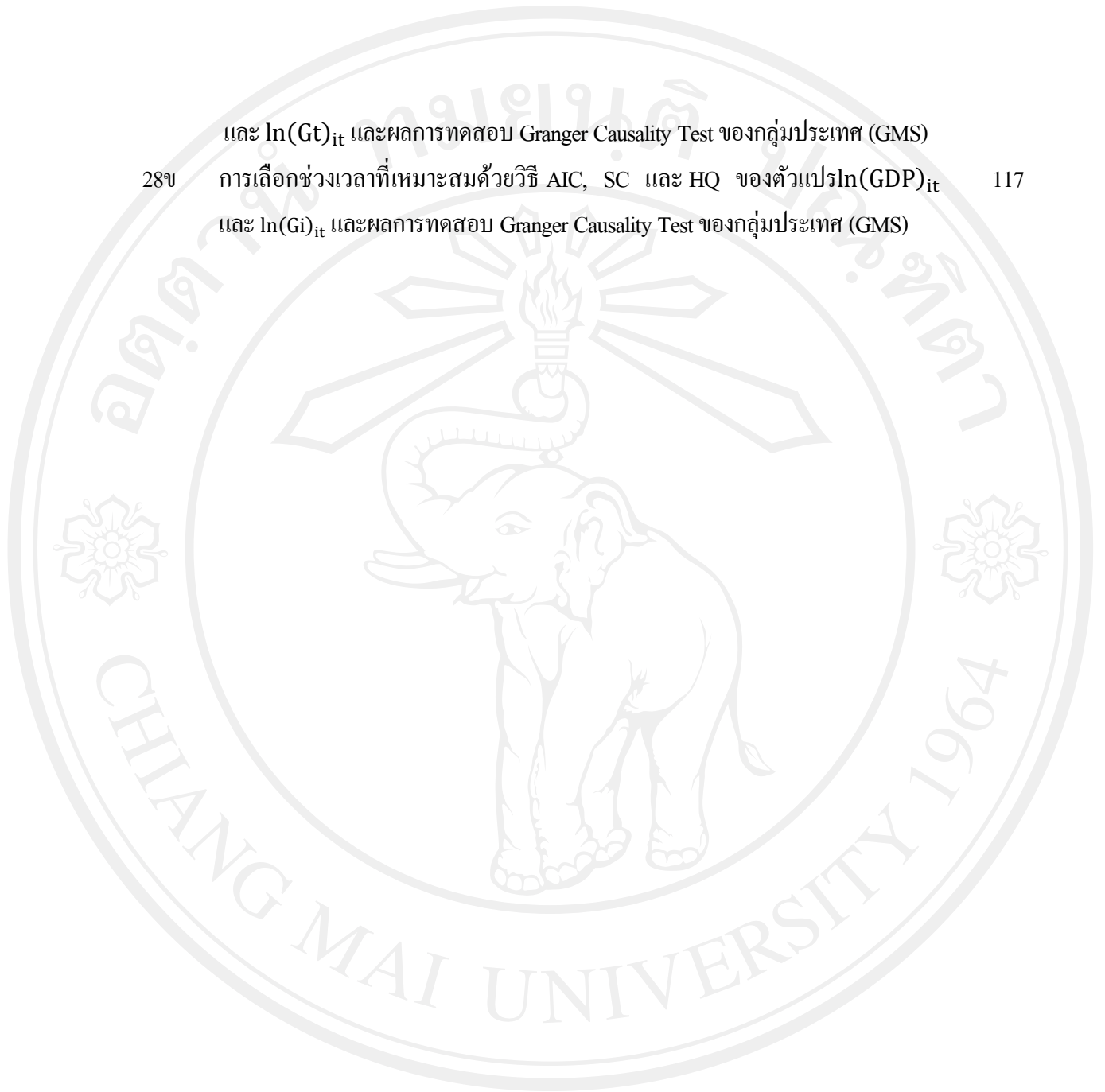
4.10	ผลการทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะสั้นด้วยวิธีของ (Error Correction Mechanism: ECM) ระหว่างตัวแปร $\ln(\text{GDP})_{it}$ กับ $\ln(\text{Gi})_{it}$ ของกลุ่มประเทศ GMS	75
4.11	การเลือกช่วงเวลาที่เหมาะสมด้วยวิธี AIC, SC และ HQ ของตัวแปร $\ln(\text{GDP})_{it}$ และ $\ln(\text{Gt})_{it}$	76
4.12	ผลการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล: ระหว่างตัวแปร $\ln(\text{GDP})_{it}$ และ $\ln(\text{Gt})_{it}$	77
4.13	การเลือกช่วงเวลาที่เหมาะสมด้วยวิธี AIC, SC และ HQ ของตัวแปร $\ln(\text{GDP})_{it}$ และ $\ln(\text{Gi})_{it}$	78
4.14	ผลการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผล: ระหว่างตัวแปร $\ln(\text{GDP})_{it}$ และ $\ln(\text{Gi})_{it}$	79

สารบัญตารางภาคผนวก

ตารางภาคผนวก		หน้า
1ก	รายชื่อประเทศ และ ประเภทข้อมูลที่นำมาใช้ในการศึกษา	90
1ข	ผลการทดสอบความนิ่งของ $\ln(\text{GDP})_{it}$ ที่ระดับ Level หรือ $I(0)$: ของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของกลุ่มประเทศในอนุภูมิภาคลุ่มแม่น้ำโขง	94
2ข	ผลการทดสอบความนิ่งของ $\ln(\text{GDP})_{it}$ ที่ระดับ 1 st Difference หรือ $I(1)$: ของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของกลุ่มประเทศในอนุภูมิภาคลุ่มแม่น้ำโขง	94
3ข	ผลการทดสอบความนิ่งของ $\ln(\text{Gt})_{it}$ ที่ระดับ Level หรือ $I(0)$: การใช้จ่ายรวมของภาครัฐบาลของกลุ่มประเทศในอนุภูมิภาคลุ่มแม่น้ำโขง	95
4ข	ผลการทดสอบความนิ่งของ $\ln(\text{Gt})_{it}$ ที่ระดับ 1 st Difference หรือ $I(1)$: ของการใช้จ่ายรวมของภาครัฐบาลของกลุ่มประเทศในอนุภูมิภาคลุ่มแม่น้ำโขง	95
5ข	ผลการทดสอบความนิ่งของ $\ln(\text{Gc})_{it}$ ที่ระดับ Level หรือ $I(0)$: ของการใช้จ่ายของรัฐบาลเพื่อการบริโภคของกลุ่มประเทศในอนุภูมิภาคลุ่มแม่น้ำโขง	96
6ข	ผลการทดสอบความนิ่งของ $\ln(\text{Gc})_{it}$ ที่ระดับ 1 st Difference หรือ $I(1)$: ของการใช้จ่ายของรัฐบาลเพื่อการบริโภคของกลุ่มประเทศในอนุภูมิภาคลุ่มแม่น้ำโขง	96
7ข	ผลการทดสอบความนิ่งของ $\ln(\text{Gi})_{it}$ ที่ระดับ Level หรือ $I(0)$: ของการใช้จ่ายของรัฐบาลเพื่อการลงทุนของกลุ่มประเทศในอนุภูมิภาคลุ่มแม่น้ำโขง	97
8ข	ผลการทดสอบความนิ่งของ $\ln(\text{Gi})_{it}$ ที่ระดับ 1 st Difference หรือ $I(1)$: ของการใช้จ่ายของรัฐบาลเพื่อการลงทุนของกลุ่มประเทศในอนุภูมิภาคลุ่มแม่น้ำโขง	97
9ข	ผลการทดสอบพหุเนลโคอินทิเกรชัน: ของ $\ln(\text{GDP})_{it}$ กับ $\ln(\text{Gt})_{it}$ ด้วยวิธี Pedroni Residual Cointegration Test ของกลุ่มประเทศในอนุภูมิภาคลุ่มแม่น้ำโขง	98
10ข	ผลการทดสอบพหุเนลโคอินทิเกรชัน: ของ $\ln(\text{GDP})_{it}$ กับ $\ln(\text{Gt})_{it}$ ด้วยวิธี Kao Residual Cointegration Test ของกลุ่มประเทศในอนุภูมิภาคลุ่มแม่น้ำโขง	99
11ข	ผลการทดสอบพหุเนลโคอินทิเกรชัน: ของ $\ln(\text{GDP})_{it}$ กับ $\ln(\text{Gc})_{it}$ ด้วยวิธี Pedroni Residual Cointegration Test ของกลุ่มประเทศในอนุภูมิภาคลุ่มแม่น้ำโขง	100
12ข	ผลการทดสอบพหุเนลโคอินทิเกรชัน: ของ $\ln(\text{GDP})_{it}$ กับ $\ln(\text{Gc})_{it}$ ด้วยวิธี Kao Residual Cointegration Test ของกลุ่มประเทศในอนุภูมิภาคลุ่มแม่น้ำโขง	101

13ข	ผลการทดสอบพหุสมการโคอินทิเกรชัน: ของ $\ln(\text{GDP})_{it}$ กับ $\ln(\text{Gi})_{it}$ ด้วยวิธี Pedroni Residual Cointegration Test ของกลุ่มประเทศในอนุภูมิภาคกลุ่มแม่น้ำโขง	102
14ข	ผลการทดสอบพหุสมการโคอินทิเกรชัน: ของ $\ln(\text{GDP})_{it}$ กับ $\ln(\text{Gi})_{it}$ ด้วยวิธี Kao Residual Cointegration Test ของกลุ่มประเทศในอนุภูมิภาคกลุ่มแม่น้ำโขง	103
15ข	ผลการทดสอบสมการพหุสมการพหุสมการด้วยวิธี Hausman Test: ระหว่างตัวแปรตาม $\ln(\text{GDP})_{it}$ และตัวแปรอิสระ $\ln(\text{Gt})_{it}$	104
16ข	ผลการทดสอบสมการพหุสมการพหุสมการด้วยวิธี Redundant Fixed Effects Test: ระหว่างตัวแปรตาม $\ln(\text{GDP})_{it}$ และตัวแปรอิสระ $\ln(\text{Gt})_{it}$	105
17ข	ผลการทดสอบสมการพหุสมการพหุสมการด้วยวิธี Hausman Test: ระหว่างตัวแปรตาม $\ln(\text{GDP})_{it}$ และตัวแปรอิสระ $\ln(\text{Gi})_{it}$	106
18ข	ผลการทดสอบสมการพหุสมการพหุสมการด้วยวิธี Redundant Fixed Effects Test: ระหว่างตัวแปร ตาม $\ln(\text{GDP})_{it}$ และตัวแปรอิสระ $\ln(\text{Gi})_{it}$	107
19ข	ผลการประมาณค่าความสัมพันธ์ของกลุ่มประเทศ GMS ระหว่างตัวแปรตาม $\ln(\text{GDP})_{it}$ และตัวแปรอิสระ $\ln(\text{Gt})_{it}$ ด้วยวิธี OLS	108
20ข	ผลการประมาณค่าความสัมพันธ์ของกลุ่มประเทศ GMS ระหว่างตัวแปรตาม $\ln(\text{GDP})_{it}$ และตัวแปรอิสระ $\ln(\text{Gt})_{it}$ ด้วยวิธี DOLS	109
21ข	ผลการประมาณค่าความสัมพันธ์ของกลุ่มประเทศ GMS ระหว่างตัวแปรตาม $\ln(\text{GDP})_{it}$ และตัวแปรอิสระ $\ln(\text{Gt})_{it}$ ด้วยวิธี GMM	110
22ข	ผลการประมาณค่าความสัมพันธ์ของกลุ่มประเทศ GMS ระหว่างตัวแปรตาม $\ln(\text{GDP})_{it}$ และตัวแปรอิสระ $\ln(\text{Gi})_{it}$ ด้วยวิธี OLS	111
23ข	ผลการประมาณค่าความสัมพันธ์ของกลุ่มประเทศ GMS ระหว่างตัวแปรตาม $\ln(\text{GDP})_{it}$ และตัวแปรอิสระ $\ln(\text{Gi})_{it}$ ด้วยวิธี DOLS	112
24ข	ผลการประมาณค่าความสัมพันธ์ของกลุ่มประเทศ GMS ระหว่างตัวแปรตาม $\ln(\text{GDP})_{it}$ และตัวแปรอิสระ $\ln(\text{Gi})_{it}$ ด้วยวิธี GMM	113
25ข	ผลการทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะสั้นด้วยวิธีของ Error Correction Mechanism: ECM) ระหว่างตัวแปรตาม $\ln(\text{GDP})_{it}$ กับตัวแปรอิสระ $\ln(\text{Gt})_{it}$	114
26ข	ผลการทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะสั้นด้วยวิธีของ Error Correction Mechanism: ECM) ระหว่างตัวแปรตาม $\ln(\text{GDP})_{it}$ กับตัวแปรอิสระ $\ln(\text{Gi})_{it}$	115
27ข	การเลือกช่วงเวลาที่เหมาะสมด้วยวิธี AIC, SC และ HQ ของตัวแปร $\ln(\text{GDP})_{it}$	116

- และ $\ln(Gt)_{it}$ และผลการทดสอบ Granger Causality Test ของกลุ่มประเทศ (GMS)
28๗ การเลือกช่วงเวลาที่เหมาะสมด้วยวิธี AIC, SC และ HQ ของตัวแปร $\ln(GDP)_{it}$ 117
และ $\ln(Gi)_{it}$ และผลการทดสอบ Granger Causality Test ของกลุ่มประเทศ (GMS)



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved