ภาคผนวก

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

ภาคผนวก ก

ตารางภาคผนวก 1 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root) ของเงินลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศ

Null Hypothesis: D(FDI) has a unit root

Exogenous: Constant

Lag Length: 1 (Automatic based on SIC, MAXLAG=12)

		t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic		-13.04627	0.0000
Test critical values:	1% level	-3.481623	
	5% level	-2.883930	
	10% level	-2.578788	

Null Hypothesis: D(FDI) has a unit root

Exogenous: Constant, Linear Trend

Lag Length: 1 (Automatic based on SIC, MAXLAG=12)

		t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic		-12.99723	0.0000
Test critical values:	1% level	-4.030729	
	5% level	-3.445030	
	10% level	-3.147382	

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

Null Hypothesis: D(FDI) has a unit root

Exogenous: None

Lag Length: 1 (Automatic based on SIC, MAXLAG=12)

		t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic		-13.09771	0.0000
Test critical values:	1% level	-2.583011	
	5% level	-1.943324	
	10% level	-1.615075	

ที่มา: จากการคำนวณ

ตารางภาคผนวก 2 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root) ของดัชนีผู้บริโภค

Null Hypothesis: D(CPI) has a unit root

Exogenous: Constant

Lag Length: 0 (Automatic based on SIC, MAXLAG=12)

		t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic		-7.711981	0.0000
Test critical values:	1% level	-3.481217	
	5% level	-2.883753	
	10% level	-2.578694	

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

Null Hypothesis: D(CPI) has a unit root

Exogenous: Constant, Linear Trend

Lag Length: 1 (Automatic based on SIC, MAXLAG=12)

		t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic		-8.296273	0.0000
Test critical values:	1% level	-4.030729	
	5% level	-3.445030	
	10% level	-3.147382	

Null Hypothesis: D(CPI) has a unit root

Exogenous: None

Lag Length: 0 (Automatic based on SIC, MAXLAG=12)

		t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic		-7.162262	0.0000
Test critical values:	1% level	-2.582872	
	5% level	-1.943304	
	10% level	-1.615087	

ที่มา: จากการคำนวณ

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

ตารางภาคผนวก 3 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root) ของดัชนีผลผลิตอุตสาหกรรม

Null Hypothesis: D(MPI) has a unit root

Exogenous: Constant

Lag Length: 11 (Automatic based on SIC, MAXLAG=12)

		t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic		-6.617505	0.0000
Test critical values:	1% level	-3.486064	
	5% level	-2.885863	
	10% level	-2.579818	

Null Hypothesis: D(MPI) has a unit root

Exogenous: Constant, Linear Trend

Lag Length: 11 (Automatic based on SIC, MAXLAG=12)

		t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic		-6.587090	0.0000
Test critical values:	1% level	-4.036983	
	5% level	-3.448021	
	10% level	-3.149135	

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

Null Hypothesis: D(MPI) has a unit root

Exogenous: None

Lag Length: 12 (Automatic based on SIC, MAXLAG=12)

		t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic		-4.192996	0.0000
Test critical values:	1% level	-2.584707	
	5% level	-1.943563	
	10% level	-1.614927	

ที่มา: จากการคำนวณ

ตารางภาคผนวก 4 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ

Null Hypothesis: D(EXC) has a unit root

Exogenous: Constant

Lag Length: 0 (Automatic based on SIC, MAXLAG=12)

		t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic		-9.717024	0.0000
Test critical values:	1% level	-3.481217	
	5% level	-2.883753	
	10% level	-2.578694	

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

Null Hypothesis: D(EXC) has a unit root

Exogenous: Constant, Linear Trend

Lag Length: 0 (Automatic based on SIC, MAXLAG=12)

		t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic		-9.567182	0.0000
Test critical values:	1% level	-4.030157	
	5% level	-3.444756	
	10% level	-3.147221	

Null Hypothesis: D(EXC) has a unit root

Exogenous: None

Lag Length: 0 (Automatic based on SIC, MAXLAG=12)

		t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic		-9.782917	0.0000
Test critical values:	1% level	-2.582872	
	5% level	-1.943304	
	10% level	-1.615087	

ที่มา: จากการคำนวณ

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

ตารางภาคผนวก 5 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root) ของอัตราดอกเบี้ยเงินกู้ (MLR)

Null Hypothesis: D(R) has a unit root

Exogenous: Constant

Lag Length: 2 (Automatic based on SIC, MAXLAG=12)

		t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic		-3.232078	0.0204
Test critical values:	1% level	-3.482035	
	5% level	-2.884109	
	10% level	-2.578884	

Null Hypothesis: D(R) has a unit root

Exogenous: Constant, Linear Trend

Lag Length: 2 (Automatic based on SIC, MAXLAG=12)

		t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic		-3.635323	0.0307
Test critical values:	1% level	-4.031309	
	5% level	-3.445308	
	10% level	-3.147545	

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

Null Hypothesis: D(R) has a unit root

Exogenous: None

Lag Length: 2 (Automatic based on SIC, MAXLAG=12)

		t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic		-3.026709	0.0027
Test critical values:	1% level	-2.583153	
	5% level	-1.943344	
	10% level	-1.615062	

ที่มา: จากการคำนวณ

ตารางภาคผนวก 6 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root) ของมูลค่าการส่งออกอาหาร

Null Hypothesis: D(EX) has a unit root

Exogenous: Constant

Lag Length: 0 (Automatic based on SIC, MAXLAG=12)

		t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic		-14.55996	0.0000
Test critical values:	1% level	-3.481217	
	5% level	-2.883753	
	10% level	-2.578694	

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

Null Hypothesis: D(EX) has a unit root

Exogenous: Constant, Linear Trend

Lag Length: 0 (Automatic based on SIC, MAXLAG=12)

		t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic		-14.56658	0.0000
Test critical values:	1% level	-4.030157	
	5% level	-3.444756	
	10% level	-3.147221	

Null Hypothesis: D(EX) has a unit root

Exogenous: None

Lag Length: 0 (Automatic based on SIC, MAXLAG=12)

		t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic		-14.60768	0.0000
Test critical values:	1% level	-2.582872	
	5% level	-1.943304	
	10% level	-1.615087	

ที่มา: จากการคำนวณ

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

ตารางภาคผนวก 7 ผลการทดสอบจากแบบจำลอง ARIMAX

Dependent Variable: D(FDI)

Method: Least Squares

Date: 09/07/09 Time: 00:01

Sample (adjusted): 12 132

Included observations: 121 after adjustments

Convergence achieved after 42 iterations

MA Backcast: 2 11

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-21.51205	8.854347	-2.429547	0.0168
D(CPI)	-0.763731	44.17586	-0.017288	0.9862
D(MPI)	-1.339943	4.201191	-0.318943	0.7504
D(EXC)	-77.71602	40.98759	-1.896086	0.0606
D(R)	-504.6069	81.87492	-6.163144	0.0000
D(EX)	0.051453	0.022032	2.335354	0.0214
AR(1)	-0.211927	0.104531	-2.027403	0.0451
AR(4)	-0.171604	0.090293	-1.900517	0.0600
AR(10)	-0.212856	0.105123	-2.024821	0.0453
MA(1)	-0.925741	0.076882	-12.04114	0.0000
MA(3)	-0.205287	0.095318	-2.153708	0.0335
MA(10)	0.142544	0.020063	7.104846	0.0000

ที่มา: จากการคำนวณ

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

ตารางภาคผนวก 7 ผลการทดสอบจากแบบจำลอง ARIMAX (ต่อ)

R-squared	0.609091	Mean dependent var	-1.453554
Adjusted R-squared	0.569641	S.D. dependent var	1768.920
S.E. of regression	1160.442	Akaike info criterion	17.04489
Sum squared resid	1.47E+08	Schwarz criterion	17.32216
Log likelihood	-1019.216	Hannan-Quinn criter.	17.15750
F-statistic	15.43975	Durbin-Watson stat	2.032167
Prob(F-statistic)	0.000000		

ที่มา: จากการคำนวณ

ตารางภาคผนวก 8 ผลการทดสอบ Autocorrelation

Breusch-Godfrey Serial Correlation LM Test:

F-statistic	0.459287	Prob. F(2,107)	0.6330
Obs*R-squared	1.029554	Prob. Chi-Square(2)	0.5976

ที่มา: จากการคำนวณ

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

ประวัติผู้เขียน

ชื่อ	นางสาวจุติพร ฟูเต็มวงค์
วัน เดือน ปี เกิด	31 พฤษภาคม 2529
ประวัติการศึกษา	สำเร็จการศึกษามัธยมตอนปลายโรงเรียนนารีรัตน์จังหวัดแพร่ ปีการศึกษา 2546 สำเร็จการศึกษาปริญญาตรี เศรษฐศาสตรบัณฑิต สาขาเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยแม่ฟ้าหลวง ปีการศึกษา 2550
ประสบการณ์	-

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved