



ภาคผนวก

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

ภาคผนวก ก ผลประเทศไทยมาเลเซีย

ตารางภาคผนวกที่ 1 การนำตัวแปรอัตราแลกเปลี่ยนบาทต่อริงกิตของมาเลเซีย (Ex_t^{my}) มาทดสอบ
ใน Correlogram Test

Date: 05/19/10 Time: 13:54
Sample: 1 96
Included observations: 95

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
		1	0.261	0.261	6.6765	0.010
		2	-0.038	-0.114	6.8210	0.033
		3	-0.105	-0.070	7.9250	0.048
		4	-0.085	-0.044	8.6528	0.070
		5	-0.144	-0.133	10.781	0.056
		6	-0.180	-0.136	14.120	0.028
		7	-0.245	-0.217	20.393	0.005
		8	0.016	0.088	20.420	0.009
		9	-0.100	-0.241	21.501	0.011
		10	0.071	0.106	22.049	0.015
		11	0.041	-0.109	22.232	0.023
		12	-0.139	-0.268	24.391	0.018
		13	0.037	0.113	24.541	0.027
		14	0.161	-0.009	27.476	0.017
		15	0.088	0.016	28.374	0.019
		16	0.003	-0.117	28.375	0.029
		17	-0.057	0.012	28.758	0.037
		18	0.092	0.056	29.764	0.040
		19	0.080	-0.025	30.540	0.045
		20	-0.106	-0.026	31.920	0.044
		21	-0.104	-0.116	33.277	0.043
		22	-0.048	0.058	33.569	0.054
		23	0.046	0.052	33.844	0.067
		24	0.010	-0.099	33.858	0.087

ตารางภาคผนวกที่ 2 การนำตัวแปรอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อริงกิตของมาเลเซีย (Ex_t^{my}) มาหา

ความสัมพันธ์กับ AR และ MA

Dependent Variable: D(MYR)

Method: Least Squares

Date: 05/19/10 Time: 14:01

Sample (adjusted): 5 96

Included observations: 92 after adjustments

Convergence achieved after 11 iterations

MA Backcast: 2 4

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.015025	0.004604	-3.263489	0.0016
AR(3)	0.638906	0.083673	7.635703	0.0000
MA(3)	-0.946026	0.022395	-42.24204	0.0000
R-squared	0.144479	Mean dependent var		-0.018262
Adjusted R-squared	0.125254	S.D. dependent var		0.136092
S.E. of regression	0.127284	Akaike info criterion		-1.252725
Sum squared resid	1.441911	Schwarz criterion		-1.170493
Log likelihood	60.62535	Hannan-Quinn criter.		-1.219535
F-statistic	7.515095	Durbin-Watson stat		1.586645
Prob(F-statistic)	0.000964			
Inverted AR Roots	.86	-.43+.75i	-.43-.75i	
Inverted MA Roots	.98	-.49-.85i	-.49+.85i	

ตารางภาคผนวกที่ 3 การนำตัวแปรอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อริงกิตของมาเลเซีย (Ex_t^{my}) มาทดสอบ

Serial Correlation

Breusch-Godfrey Serial Correlation LM Test:				
F-statistic	2.015699	Prob. F(2,87)	0.1394	
Obs*R-squared	4.020518	Prob. Chi-Square(2)	0.1340	
Test Equation:				
Dependent Variable: RESID				
Method: Least Squares				
Date: 05/19/10 Time: 14:04				
Sample: 5 96				
Included observations: 92				
Presample missing value lagged residuals set to zero.				
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	3.32E-05	0.004552	0.007301	0.9942
AR(3)	0.022858	0.083518	0.273692	0.7850
MA(3)	-0.005294	0.022385	-0.236511	0.8136
RESID(-1)	0.212106	0.108377	1.957110	0.0535
RESID(-2)	-0.090532	0.108205	-0.836675	0.4051
R-squared	0.043701	Mean dependent var	-0.003095	
Adjusted R-squared	-0.000266	S.D. dependent var	0.125839	
S.E. of regression	0.125856	Akaike info criterion	-1.254543	
Sum squared resid	1.378055	Schwarz criterion	-1.117489	
Log likelihood	62.70898	Hannan-Quinn criter.	-1.199227	
F-statistic	0.993939	Durbin-Watson stat	1.948748	
Prob(F-statistic)	0.415307			

ตารางภาคผนวกที่ 4 การนำแบบจำลองอัตราแลกเปลี่ยนของมาเลเซียมาประมาณค่าด้วยวิธี

GRACH

Dependent Variable: D(MYR)

Method: ML - ARCH (Marquardt) - Normal distribution

Date: 05/19/10 Time: 14:21

Sample (adjusted): 5 96

Included observations: 92 after adjustments

Convergence achieved after 55 iterations

MA Backcast: 2 4

Presample variance: backcast (parameter = 0.7)

GARCH = C(4) + C(5)*RESID(-1)^2 + C(6)*GARCH(-1)

Variable	Coefficient	Std. Error	z-Statistic	Prob.
C	-0.014941	0.003564	-4.192097	0.0000
AR(3)	0.603394	0.070929	8.506967	0.0000
MA(3)	-0.944122	0.027828	-33.92658	0.0000
Variance Equation				
C	0.000664	0.000573	1.157633	0.2470
RESID(-1)^2	-0.133569	0.073951	-1.806178	0.0709
GARCH(-1)	1.078749	0.061022	17.67810	0.0000
R-squared	0.142741	Mean dependent var		-0.018262
Adjusted R-squared	0.092901	S.D. dependent var		0.136092
S.E. of regression	0.129617	Akaike info criterion		-1.338330
Sum squared resid	1.444840	Schwarz criterion		-1.173866
Log likelihood	67.56320	Hannan-Quinn criter.		-1.271951
F-statistic	2.863953	Durbin-Watson stat		1.616005
Prob(F-statistic)	0.019336			
Inverted AR Roots	.85	-.42+.73i		-.42-.73i
Inverted MA Roots	.98	-.49-.85i		-.49+.85i

ตารางภาคผนวกที่ 5 การประมาณค่าสมการถดถอยของตัวแปรทั้งหมดของมาเลเซียด้วยวิธี

Ordinary Least Square

Dependent Variable: LNXM

Method: Least Squares

Date: 05/20/10 Time: 15:57

Sample (adjusted): 5 95

Included observations: 91 after adjustments

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	5.542379	0.157575	35.17307	0.0000
LN YM	-0.539774	0.264572	-2.040173	0.0444
LN PM	-9.303932	0.858350	-10.83932	0.0000
LN HM	-0.023283	0.036487	-0.638102	0.5251
R-squared	0.669923	Mean dependent var		5.212120
Adjusted R-squared	0.658541	S.D. dependent var		0.259268
S.E. of regression	0.151502	Akaike info criterion		-0.893477
Sum squared resid	1.996895	Schwarz criterion		-0.783109
Log likelihood	44.65319	Hannan-Quinn criter.		-0.848950
F-statistic	58.85819	Durbin-Watson stat		0.777790
Prob(F-statistic)	0.000000			

ตารางภาคผนวกที่ 6 การทดสอบ Unit root ของส่วนที่เหลือจากสมการถดถอยของมาเลเซีย

$$(\hat{e}_t^{my})$$

Null Hypothesis: E1 has a unit root

Exogenous: None

Lag Length: 0 (Fixed)

	t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic	-4.647472	0.0000
Test critical values:		
1% level	-2.590910	
5% level	-1.944445	
10% level	-1.614392	

*MacKinnon (1996) one-sided p-values.

Augmented Dickey-Fuller Test Equation

Dependent Variable: D(E1)

Method: Least Squares

Date: 05/20/10 Time: 16:03

Sample (adjusted): 6 95

Included observations: 90 after adjustments

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
E1(-1)	-0.389761	0.083865	-4.647472	0.0000
R-squared	0.195280	Mean dependent var		0.000487
Adjusted R-squared	0.195280	S.D. dependent var		0.132102
S.E. of regression	0.118504	Akaike info criterion		-1.416690
Sum squared resid	1.249846	Schwarz criterion		-1.388914
Log likelihood	64.75105	Hannan-Quinn criter.		-1.405489
Durbin-Watson stat	2.322215			

ตารางภาคผนวกที่ 7 การทดสอบ Error Correction Model (ECM) กรณีผลกระทบต่อลอการิทึมของ
มูลค่า สินค้าส่งออกที่แท้จริงไปประเทศมาเลเซีย

Dependent Variable: D(LNXM)
Method: Least Squares
Date: 05/25/10 Time: 01:24
Sample (adjusted): 9 96
Included observations: 88 after adjustments

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.014089	0.009860	1.428877	0.1568
D(LNYM(-2))	0.642351	0.189505	3.389636	0.0011
D(LNPM(-2))	2.175153	1.462903	1.486874	0.1408
D(LNHM(-3))	0.112824	0.044844	2.515912	0.0138
E1(-1)	-0.427915	0.067296	-6.358695	0.0000
R-squared	0.440027	Mean dependent var		0.008894
Adjusted R-squared	0.413041	S.D. dependent var		0.119885
S.E. of regression	0.091848	Akaike info criterion		-1.882225
Sum squared resid	0.700191	Schwarz criterion		-1.741467
Log likelihood	87.81790	Hannan-Quinn criter.		-1.825517
F-statistic	16.30538	Durbin-Watson stat		2.240432
Prob(F-statistic)	0.000000			

ภาคผนวก ข ผลประเทศสิงคโปร์

ตารางภาคผนวกที่ 8 การนำตัวแปรอัตราแลกเปลี่ยนมาทดสอบค่าคงที่ของสิงคโปร์ (Ex_t^{sg})

มาทดสอบใน Correlogram Test

Date: 05/19/10 Time: 15:04

Sample: 1 96

Included observations: 95

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
		1	0.285	0.285	7.9775	0.005
		2	-0.001	-0.090	7.9776	0.019
		3	-0.095	-0.075	8.8781	0.031
		4	-0.295	-0.270	17.697	0.001
		5	-0.094	0.070	18.598	0.002
		6	-0.029	-0.054	18.684	0.005
		7	-0.051	-0.073	18.960	0.008
		8	0.108	0.075	20.204	0.010
		9	0.047	-0.020	20.444	0.015
		10	-0.015	-0.038	20.467	0.025
		11	-0.105	-0.145	21.669	0.027
		12	-0.286	-0.214	30.733	0.002
		13	-0.149	-0.030	33.217	0.002
		14	0.044	0.053	33.432	0.002
		15	0.151	0.069	36.044	0.002
		16	0.096	-0.128	37.125	0.002
		17	-0.015	-0.040	37.154	0.003
		18	-0.028	-0.018	37.244	0.005
		19	-0.048	-0.023	37.527	0.007
		20	0.009	0.042	37.536	0.010
		21	-0.066	-0.109	38.084	0.013
		22	-0.001	0.035	38.084	0.018
		23	0.044	-0.055	38.328	0.023
		24	-0.000	-0.082	38.328	0.032

ตารางภาคผนวกที่ 9 การนำตัวแปรอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อดอลลาร์สิงคโปร์ของสิงคโปร์ (Ex_t^{sg})

มาหาความสัมพันธ์กับ AR และ MA

Dependent Variable: D(SD)

Method: Least Squares

Date: 05/19/10 Time: 15:15

Sample (adjusted): 3 96

Included observations: 94 after adjustments

Convergence achieved after 9 iterations

MA Backcast: 2

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.001811	0.031488	-0.057517	0.9543
AR(1)	-0.404065	0.215930	-1.871283	0.0645
MA(1)	0.703954	0.166445	4.229343	0.0001
R-squared	0.101114	Mean dependent var		-0.001563
Adjusted R-squared	0.081359	S.D. dependent var		0.262865
S.E. of regression	0.251945	Akaike info criterion		0.112183
Sum squared resid	5.776346	Schwarz criterion		0.193352
Log likelihood	-2.272619	Hannan-Quinn criter.		0.144970
F-statistic	5.118223	Durbin-Watson stat		1.916703
Prob(F-statistic)	0.007826			
Inverted AR Roots	-40			
Inverted MA Roots	-.70			

ตารางภาคผนวกที่ 10 การนำตัวแปรอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อดอลลาร์สิงคโปร์ของสิงคโปร์
(Ex_t^{sg}) มาทดสอบ Serial Correlation

Breusch-Godfrey Serial Correlation LM Test:				
F-statistic	0.693016	Prob. F(2,89)	0.5027	
Obs*R-squared	1.441167	Prob. Chi-Square(2)	0.4865	
Test Equation:				
Dependent Variable: RESID				
Method: Least Squares				
Date: 05/19/10 Time: 15:13				
Sample: 3 96				
Included observations: 94				
Presample missing value lagged residuals set to zero.				
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.000227	0.031597	-0.007169	0.9943
AR(1)	-0.723599	0.981790	-0.737020	0.4630
MA(1)	0.194626	0.254847	0.763697	0.4471
RESID(-1)	0.571435	0.804350	0.710431	0.4793
RESID(-2)	-0.073327	0.291178	-0.251829	0.8018
R-squared	0.015332	Mean dependent var	0.000434	
Adjusted R-squared	-0.028923	S.D. dependent var	0.249221	
S.E. of regression	0.252799	Akaike info criterion	0.139283	
Sum squared resid	5.687768	Schwarz criterion	0.274565	
Log likelihood	-1.546310	Hannan-Quinn criter.	0.193927	
F-statistic	0.346439	Durbin-Watson stat	1.998352	
Prob(F-statistic)	0.845858			

ตารางภาคผนวกที่ 11 การนำแบบจำลองอัตราแลกเปลี่ยนของสิงคโปร์มาประมาณค่าด้วยวิธี

GRACH

Dependent Variable: D(SD)

Method: ML - ARCH (Marquardt) - Normal distribution

Date: 05/20/10 Time: 16:21

Sample (adjusted): 3 96

Included observations: 94 after adjustments

Convergence achieved after 45 iterations

MA Backcast: 2

Presample variance: backcast (parameter = 0.7)

GARCH = C(4) + C(5)*RESID(-1)^2 + C(6)*GARCH(-1)

Variable	Coefficient	Std. Error	z-Statistic	Prob.
C	-0.001473	0.033589	-0.043851	0.9650
AR(1)	-0.535774	0.204995	-2.613600	0.0090
MA(1)	0.820017	0.104257	7.865349	0.0000
Variance Equation				
C	0.010212	0.012955	0.788293	0.4305
RESID(-1)^2	0.088948	0.116217	0.765363	0.4441
GARCH(-1)	0.750822	0.309847	2.423200	0.0154
R-squared	0.096302	Mean dependent var		-0.001563
Adjusted R-squared	0.044956	S.D. dependent var		0.262865
S.E. of regression	0.256888	Akaike info criterion		0.141691
Sum squared resid	5.807267	Schwarz criterion		0.304029
Log likelihood	-0.659470	Hannan-Quinn criter.		0.207264
F-statistic	1.875541	Durbin-Watson stat		1.886035
Prob(F-statistic)	0.106674			
Inverted AR Roots	-.54			
Inverted MA Roots	-.82			

ตารางภาคผนวกที่ 12 การประมาณค่าสมการถดถอยของตัวแปรทั้งหมดของลิงคโปรัดววยวิธี

Ordinary Least Square

Dependent Variable: LNXS				
Method: Least Squares				
Date: 05/20/10 Time: 19:48				
Sample (adjusted): 3 95				
Included observations: 93 after adjustments				
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	5.786879	0.305593	18.93658	0.0000
LNYS	0.366369	0.209556	1.748306	0.0839
LNPS	-1.661348	0.485531	-3.421714	0.0009
LNHS	0.054344	0.079136	0.686716	0.4940
R-squared	0.166811	Mean dependent var		5.455354
Adjusted R-squared	0.138725	S.D. dependent var		0.183115
S.E. of regression	0.169940	Akaike info criterion		-0.664686
Sum squared resid	2.570281	Schwarz criterion		-0.555757
Log likelihood	34.90788	Hannan-Quinn criter.		-0.620703
F-statistic	5.939480	Durbin-Watson stat		1.044568
Prob(F-statistic)	0.000970			

ตารางภาคผนวกที่ 13 การทดสอบ Unit root ของส่วนที่เหลือจากสมการถดถอยของสิงคโปร์
(\hat{e}_t^{sg})

Null Hypothesis: E2 has a unit root				
Exogenous: None				
Lag Length: 0 (Fixed)				
			t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic			-5.650547	0.0000
Test critical values:	1% level		-2.590340	
	5% level		-1.944364	
	10% level		-1.614441	
*MacKinnon (1996) one-sided p-values.				
Augmented Dickey-Fuller Test Equation				
Dependent Variable: D(E2)				
Method: Least Squares				
Date: 05/20/10 Time: 19:50				
Sample (adjusted): 4 95				
Included observations: 92 after adjustments				
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
E2(-1)	-0.522771	0.092517	-5.650547	0.0000
R-squared	0.259639	Mean dependent var		-0.001926
Adjusted R-squared	0.259639	S.D. dependent var		0.171755
S.E. of regression	0.147786	Akaike info criterion		-0.975299
Sum squared resid	1.987492	Schwarz criterion		-0.947888
Log likelihood	45.86375	Hannan-Quinn criter.		-0.964236
Durbin-Watson stat	2.148117			

ตารางภาคผนวกที่ 14 การทดสอบ Error Correction Model (ECM)กรณีผลกระทบต่อลอการิทึม
ของมูลค่า สินค้าส่งออกที่แท้จริงไปประเทศสิงคโปร์

Dependent Variable: D(LNXS)
Method: Least Squares
Date: 05/25/10 Time: 01:50
Sample (adjusted): 6 96
Included observations: 91 after adjustments

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-7.15E-05	0.015478	-0.004618	0.9963
D(LNYS)	0.213604	0.148093	1.442361	0.1528
D(LNPS)	0.812836	1.939437	0.419109	0.6762
D(LNHS(-2))	0.224884	0.117981	1.906110	0.0600
E2(-1)	-0.538643	0.094389	-5.706656	0.0000
R-squared	0.289568	Mean dependent var		-0.000279
Adjusted R-squared	0.256525	S.D. dependent var		0.169708
S.E. of regression	0.146331	Akaike info criterion		-0.952520
Sum squared resid	1.841486	Schwarz criterion		-0.814560
Log likelihood	48.33964	Hannan-Quinn criter.		-0.896862
F-statistic	8.763294	Durbin-Watson stat		2.082677
Prob(F-statistic)	0.000006			

ภาคผนวก ค ผลประเทศอินโดนีเซีย

ตารางภาคผนวกที่ 15 การนำตัวแปรอัตราแลกเปลี่ยนบาทต่อรูเปียห์ (1000 รูเปียห์) ของอินโดนีเซีย

(Ex_t^{id}) มาทดสอบใน Correlogram Test

Date: 05/19/10 Time: 15:32
 Sample: 1 96
 Included observations: 95

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
		1	0.229	0.229	5.1298	0.024
		2	-0.043	-0.101	5.3150	0.070
		3	-0.008	0.028	5.3215	0.150
		4	-0.047	-0.060	5.5458	0.236
		5	-0.258	-0.248	12.379	0.030
		6	-0.105	0.011	13.524	0.035
		7	-0.024	-0.043	13.586	0.059
		8	0.120	0.145	15.120	0.057
		9	0.110	0.041	16.420	0.059
		10	0.082	0.003	17.150	0.071
		11	-0.056	-0.103	17.492	0.094
		12	-0.046	-0.028	17.728	0.124
		13	-0.063	-0.002	18.173	0.151
		14	0.054	0.135	18.505	0.185
		15	0.144	0.165	20.879	0.141
		16	0.002	-0.115	20.880	0.183
		17	-0.053	-0.074	21.216	0.217
		18	-0.087	-0.164	22.114	0.227
		19	0.010	0.131	22.125	0.278
		20	-0.049	0.043	22.423	0.318
		21	-0.143	-0.105	24.969	0.248
		22	-0.033	-0.039	25.109	0.292
		23	0.133	-0.012	27.363	0.241
		24	0.027	-0.025	27.457	0.284

ตารางภาคผนวกที่ 16 การนำตัวแปรอัตราแลกเปลี่ยนบาทต่อรูเปย์ (1000 รูเปย์) ของ
อินโดนีเซีย (Ex_t^{id}) มาหาความสัมพันธ์กับ AR และ MA

Dependent Variable: D(ID)

Method: Least Squares

Date: 05/26/10 Time: 11:49

Sample (adjusted): 5 96

Included observations: 92 after adjustments

Convergence achieved after 15 iterations

MA Backcast: 2 4

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.011099	0.010453	-1.061836	0.2912
AR(3)	-0.650794	0.076965	-8.455739	0.0000
MA(3)	0.949876	0.026067	36.44001	0.0000
R-squared	0.160457	Mean dependent var		-0.011546
Adjusted R-squared	0.141591	S.D. dependent var		0.091756
S.E. of regression	0.085013	Akaike info criterion		-2.059967
Sum squared resid	0.643217	Schwarz criterion		-1.977734
Log likelihood	97.75846	Hannan-Quinn criter.		-2.026777
F-statistic	8.505054	Durbin-Watson stat		1.790350
Prob(F-statistic)	0.000417			
Inverted AR Roots	.43+.75i	.43-.75i		-.87
Inverted MA Roots	.49-.85i	.49+.85i		-.98

ตารางภาคผนวกที่ 17 การนำตัวแปรอัตราแลกเปลี่ยนบาทต่อรูเปียห์ (1000 รูเปียห์) ของ
อินโดนีเซีย (Ex_t^{id}) มาทดสอบ Serial Correlation

Breusch-Godfrey Serial Correlation LM Test:				
F-statistic	0.469345	Prob. F(2,87)	0.6270	
Obs*R-squared	0.981068	Prob. Chi-Square(2)	0.6123	
Test Equation:				
Dependent Variable: RESID				
Method: Least Squares				
Date: 05/26/10 Time: 11:50				
Sample: 5 96				
Included observations: 92				
Presample missing value lagged residuals set to zero.				
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	4.69E-05	0.010516	0.004464	0.9964
AR(3)	-0.018632	0.079853	-0.233330	0.8161
MA(3)	-0.000359	0.026382	-0.013617	0.9892
RESID(-1)	0.105840	0.110752	0.955654	0.3419
RESID(-2)	0.007713	0.107902	0.071481	0.9432
R-squared	0.010664	Mean dependent var	-0.000273	
Adjusted R-squared	-0.034823	S.D. dependent var	0.084073	
S.E. of regression	0.085524	Akaike info criterion	-2.027220	
Sum squared resid	0.636351	Schwarz criterion	-1.890166	
Log likelihood	98.25212	Hannan-Quinn criter.	-1.971904	
F-statistic	0.234437	Durbin-Watson stat	1.985501	
Prob(F-statistic)	0.918256			

ตารางภาคผนวกที่ 18 การนำแบบจำลองอัตราแลกเปลี่ยนของอิน โดนีเซียมาประมาณค่าด้วยวิธี

GRACH

Dependent Variable: D(ID)

Method: ML - ARCH (Marquardt) - Normal distribution

Date: 05/26/10 Time: 00:46

Sample (adjusted): 5 96

Included observations: 92 after adjustments

Convergence achieved after 68 iterations

MA Backcast: 2 4

Presample variance: backcast (parameter = 0.7)

GARCH = C(4) + C(5)*RESID(-1)^2 + C(6)*GARCH(-1) + C(7)*GARCH(-2)

Variable	Coefficient	Std. Error	z-Statistic	Prob.
C	-0.005818	0.007635	-0.762057	0.4460
AR(3)	-0.711449	0.049709	-14.31234	0.0000
MA(3)	0.962074	0.015257	63.05810	0.0000

Variance Equation

	Coefficient	Std. Error	z-Statistic	Prob.
C	0.001955	0.001394	1.402737	0.1607
RESID(-1)^2	0.475980	0.158405	3.004838	0.0027
GARCH(-1)	-0.126632	0.047365	-2.673538	0.0075
GARCH(-2)	0.423190	0.149130	2.837731	0.0045

R-squared	0.148822	Mean dependent var	-0.011546
Adjusted R-squared	0.088739	S.D. dependent var	0.091756
S.E. of regression	0.087591	Akaike info criterion	-2.159187
Sum squared resid	0.652132	Schwarz criterion	-1.967312
Log likelihood	106.3226	Hannan-Quinn criter.	-2.081745
F-statistic	2.476930	Durbin-Watson stat	1.757218
Prob(F-statistic)	0.029504		

Inverted AR Roots	.45+.77i	.45-.77i	-.89
Inverted MA Roots	.49+.85i	.49-.85i	-.99

ตารางภาคผนวกที่ 19 การประมาณค่าสมการถดถอยของตัวแปรทั้งหมดของอินโดนีเซียด้วยวิธี

Ordinary Least Square

Dependent Variable: LNXI				
Method: Least Squares				
Date: 05/26/10 Time: 00:51				
Sample (adjusted): 5 95				
Included observations: 91 after adjustments				
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	4.596643	0.164553	27.93410	0.0000
LNVI	-1.162060	0.275843	-4.212763	0.0001
LNPI	0.467947	0.332710	1.406472	0.1631
LNHI	0.033257	0.031047	1.071177	0.2871
R-squared	0.459519	Mean dependent var		4.704777
Adjusted R-squared	0.440882	S.D. dependent var		0.292543
S.E. of regression	0.218747	Akaike info criterion		-0.158845
Sum squared resid	4.162955	Schwarz criterion		-0.048478
Log likelihood	11.22745	Hannan-Quinn criter.		-0.114319
F-statistic	24.65593	Durbin-Watson stat		0.572886
Prob(F-statistic)	0.000000			

ตารางภาคผนวกที่ 20 การทดสอบ Unit root ของส่วนที่เหลือจากสมการถดถอยของอินโดนีเซีย

$$(\hat{e}_t^{id})$$

Null Hypothesis: E3 has a unit root

Exogenous: None

Lag Length: 1 (Fixed)

	t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic	-3.143952	0.0020
Test critical values:		
1% level	-2.591204	
5% level	-1.944487	
10% level	-1.614367	

*MacKinnon (1996) one-sided p-values.

Augmented Dickey-Fuller Test Equation

Dependent Variable: D(E3)

Method: Least Squares

Date: 05/26/10 Time: 00:52

Sample (adjusted): 7 95

Included observations: 89 after adjustments

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
E3(-1)	-0.251533	0.080005	-3.143952	0.0023
D(E3(-1))	-0.138066	0.105651	-1.306820	0.1947
R-squared	0.164423	Mean dependent var		0.002489
Adjusted R-squared	0.154819	S.D. dependent var		0.164195
S.E. of regression	0.150950	Akaike info criterion		-0.921516
Sum squared resid	1.982382	Schwarz criterion		-0.865592
Log likelihood	43.00747	Hannan-Quinn criter.		-0.898975
Durbin-Watson stat	1.992916			

ตารางภาคผนวกที่ 21 การทดสอบ Error Correction Model (ECM)กรณีผลกระทบต่อลอการิทึม
ของมูลค่า สินค้าส่งออกที่แท้จริงไปประเทศอินโดนีเซีย

Dependent Variable: D(LNXI)
Method: Least Squares
Date: 05/26/10 Time: 01:13
Sample (adjusted): 8 96
Included observations: 89 after adjustments

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.009527	0.014782	0.644496	0.5210
D(LNYI(-1))	0.114121	0.201429	0.566560	0.5725
D(LNPI(-5))	0.276682	1.253990	0.220641	0.8259
D(LNHI(-2))	0.019235	0.011243	1.710875	0.0908
E3(-1)	-0.224305	0.068767	-3.261831	0.0016
R-squared	0.147959	Mean dependent var		0.009150
Adjusted R-squared	0.107385	S.D. dependent var		0.138865
S.E. of regression	0.131197	Akaike info criterion		-1.169687
Sum squared resid	1.445872	Schwarz criterion		-1.029876
Log likelihood	57.05109	Hannan-Quinn criter.		-1.113334
F-statistic	3.646694	Durbin-Watson stat		2.109020
Prob(F-statistic)	0.008660			

ประวัติผู้เขียน

ชื่อ-สกุล นางสาวนงครัตน์ สมภารจันทร์

วัน เดือน ปี เกิด 29 กรกฎาคม 2528

ประวัติการศึกษา สำเร็จการศึกษามัธยมตอนปลาย โรงเรียนยุพราชวิทยาลัย เชียงใหม่
ปีการศึกษา 2546
สำเร็จการศึกษาระดับปริญญาตรี วิทยาศาสตร์บัณฑิต
สาขาเทคโนโลยีชีวภาพ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
ปีการศึกษา 2550

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved