

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ฎ
สารบัญภาพ	ฏ
สารบัญตารางภาคผนวก	ฑ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 หลักการและเหตุผล	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	6
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา	6
1.4 ขอบเขตในการศึกษา	6
1.5 คำนิยามศัพท์	7
บทที่ 2 ทฤษฎีและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	
2.1 ทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง	8
2.1.1 ทฤษฎีการใช้จ่ายของภาครัฐ	8
2.1.2 ทฤษฎีการวิเคราะห์ทางเศรษฐมิติ	13
2.1.2.1 ข้อมูลพาแนล	13
2.1.2.2 การทดสอบพาแนลยูนิทรูท	17
2.1.2.3 การทดสอบพาแนลโคอินทิเกรชัน	26
2.1.2.4 การทดสอบสมการพาแนล	31
2.1.2.5 การประมาณค่าแบบจำลองพาแนล	32
2.1.2.6 การหาความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะสั้น	35

2.2 เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	36
บทที่ 3 ระเบียบวิธีการศึกษา	
3.1 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	39
3.2 ตัวแปรที่ใช้ในการศึกษา	39
3.2.1 ตัวแปรอิสระ	40
3.2.2 ตัวแปรตาม	40
3.3 แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา	40
3.4 วิธีการวิเคราะห์ข้อมูล	41
3.4.1 การทดสอบพหุแนลยูนิทรูท	41
3.4.2 การทดสอบพหุแนลโคอินทิเกรชัน	42
3.4.3 การทดสอบแบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา	44
3.4.4 การประมาณค่าแบบจำลองพหุแนล	46
3.4.5 การหาความสัมพันธ์เชิงคู่ลยภาพระยะสั้น	47
3.4.6 การหาความสัมพันธ์ระยะยาวโดยพิจารณาถึงความแตกต่างของ ผลกระทบในแต่ละประเทศ	47
บทที่ 4 ผลการศึกษา	
4.1 ข้อมูลทั่วไปเกี่ยวกับงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลและผลิตภัณฑ์มวลรวม ภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้	50
4.2 ผลการทดสอบพหุแนลยูนิทรูท	52
4.2.1 การทดสอบพหุแนลยูนิทรูทโดยกำหนดให้มีค่าคงที่	52
4.2.2 การทดสอบพหุแนลยูนิทรูทโดยกำหนดให้มีค่าคงที่และมีค่าแนวโน้ม	54
4.2.3 การทดสอบพหุแนลยูนิทรูทโดยกำหนดให้ไม่มีค่าคงที่และไม่มีค่าแนวโน้ม	56
4.3 ผลการทดสอบพหุแนลโคอินทิเกรชัน	58
4.4 ผลการทดสอบสมการพหุแนล	60
4.5 ผลการประมาณค่าแบบจำลองพหุแนล	63
4.6 ผลการหาความสัมพันธ์เชิงคู่ลยภาพระยะสั้น	68
4.7 ผลการประมาณค่าความสัมพันธ์ระยะยาวโดยพิจารณาค่าความแตกต่าง ของผลกระทบในแต่ละประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้	69
บทที่ 5 สรุปผลการศึกษา	
5.1 ผลการศึกษา	73

5.2 ข้อเสนอแนะ	75
เอกสารอ้างอิง	77
ภาคผนวก	
ภาคผนวก ก ผลการทดสอบพาแนลยูนิทรูท	81
ภาคผนวก ข ผลการทดสอบพาแนลโคอินทิเกรชั่น	93
ภาคผนวก ค ผลการทดสอบสมการพาแนล	97
ภาคผนวก ง ผลการประมาณค่าแบบจำลองพาแนล	100
ภาคผนวก จ ผลการหาความสัมพันธ์เชิงคุณภาพพระยะสั้น	104
ภาคผนวก ฉ ผลการหาความสัมพันธ์ระยะยาวโดยพิจารณาค่าความแตกต่างของ ผลกระทบแต่ละประเทศ	107
ประวัติผู้เขียน	109

สารบัญตาราง

ตาราง		หน้า
1.1	การเจริญเติบโตของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศที่แท้จริง (การเปลี่ยนแปลงร้อยละต่อปี)	2
2.1	สมมติฐานและค่าสถิติที่ใช้ในการทดสอบพหุแนลยูนิทรูด้วยวิธีการทดสอบที่แตกต่างกัน	25
3.1	สมมติฐานและค่าสถิติที่ใช้ในการทดสอบพหุแนลยูนิทรูด้วยวิธีการทดสอบที่แตกต่างกัน	41
4.1	ค่าเฉลี่ยของงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลและผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้	50
4.2	สัดส่วนค่าใช้จ่ายรัฐบาลต่อผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้	51
4.3	ผลการทดสอบยูนิทรูของตัวแปรที่ใช้ในการศึกษาโดยกำหนดให้มีค่าคงที่	53
4.4	ผลการทดสอบยูนิทรูของตัวแปรที่ใช้ในการศึกษาโดยกำหนดให้มีค่าคงที่และมีค่าแนวโน้ม	55
4.5	ผลการทดสอบยูนิทรูของตัวแปรที่ใช้ในการศึกษาโดยกำหนดไม่มีค่าคงที่และไม่มีค่าแนวโน้ม	57
4.6	ผลการทดสอบพหุแนล โคอินทิเกรชันแบบจำลองความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศบางประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ด้วยวิธี Pedroni Test	58
4.7	ผลการทดสอบพหุแนล โคอินทิเกรชันแบบจำลองความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ด้วยวิธี Kao Test	59
4.8	ผลการทดสอบสมการพหุแนลด้วยวิธี Redundant Fixed Effect Test	61
4.9	ผลการทดสอบสมการพหุแนลด้วยวิธี Huasman Test	61
4.10	ผลการทดสอบสมการพหุแนลด้วยวิธี LM-Test	62

4.11	ผลการประมาณค่าความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับ ผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ใน รูปแบบ Cross-section Random Effects ด้วยวิธี OLS-Estimator, DOLS- Estimator และ GMM-Estimator	63
4.12	ผลการประมาณค่าความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับ ผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ใน รูปแบบ Cross-section Random Effects ด้วยวิธี OLS-Estimator, DOLS- Estimator และ GMM-Estimator รายประเทศ	64
4.13	ผลการหาความสัมพันธ์เชิงคุณภาพระยะสั้น	68
4.14	ผลประมาณค่าความสัมพันธ์ระยะยาว โดยพิจารณาค่าความแตกต่างของ ผลกระทบในแต่ละประเทศ	70
4.15	ผลการทดสอบความนิ่งของส่วนที่เหลือตามวิธีพหุนามถุนิทรูป โดยกำหนดให้ ไม่มีทั้งค่าคงที่และค่าแนวโน้ม	72

สารบัญภาพ

รูป		หน้า
1.1	ผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศในช่วงปี 2544-2552 ของประเทศอินโดนีเซีย สิงคโปร์ มาเลเซีย และไทย	3
1.2	งบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลเมื่อเทียบกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศช่วงปี 2544-2552 ของประเทศอินโดนีเซีย สิงคโปร์ มาเลเซีย และไทย	4
1.3	ค่าใช้จ่ายรัฐบาลเมื่อเทียบกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศในช่วงปี 2544-2552 ของประเทศอินโดนีเซีย สิงคโปร์ มาเลเซีย และไทย	5
2.1	เส้นการใช้จ่ายรัฐบาลและการเปลี่ยนแปลงค่าใช้จ่ายรัฐบาล	9
2.2	งบประมาณของรัฐบาลกับระดับรายได้ประชาชาติ	10

สารบัญตารางภาคผนวก

ตารางภาคผนวก		หน้า
1 ก	ผลการทดสอบพหุคูณนิพจน์ของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศไทยในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ Level $I(0)$ โดยกำหนดให้มีค่าคงที่ (Individual Intercept)	81
2 ก	ผลการทดสอบพหุคูณนิพจน์ของงบประมาณค่าใช้จ่ายของรัฐบาลของประเทศไทยในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ Level $I(0)$ โดยกำหนดให้มีค่าคงที่ (Individual Intercept)	82
3 ก	ผลการทดสอบพหุคูณนิพจน์ของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศไทยในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ First differential $I(1)$ โดยกำหนดให้มีค่าคงที่ (Individual Intercept)	83
4 ก	ผลการทดสอบพหุคูณนิพจน์ของงบประมาณค่าใช้จ่ายของรัฐบาลของประเทศไทยในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ First Differential $I(1)$ โดยกำหนดให้มีค่าคงที่ (Individual Intercept)	84
5 ก	ผลการทดสอบพหุคูณนิพจน์ของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศไทยในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ Level $I(0)$ โดยกำหนดให้มีค่าคงที่ และแนวโน้มเวลา (Individual Intercept and Trend)	85
6 ก	ผลการทดสอบพหุคูณนิพจน์ของงบประมาณค่าใช้จ่ายของรัฐบาลของประเทศไทยในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ Level $I(0)$ โดยกำหนดให้มีค่าคงที่ และแนวโน้มเวลา (Individual Intercept and Trend)	86
7 ก	ผลการทดสอบพหุคูณนิพจน์ของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศไทยในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ First differential $I(1)$ โดยกำหนดให้มีค่าคงที่ และแนวโน้มเวลา (Individual Intercept and Trend)	87
8 ก	ผลการทดสอบพหุคูณนิพจน์ของงบประมาณค่าใช้จ่ายของรัฐบาลของประเทศไทยในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ First Differential $I(1)$ โดยกำหนดให้มีค่าคงที่ และแนวโน้มเวลา (Individual Intercept and Trend)	88

9 ก	ผลการทดสอบพหุสมการพหุคูณพหุคูณของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของ ประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ Level $I(0)$ โดยกำหนดค่าให้ไม่ มีค่าคงที่และแนวโน้มเวลา (None)	89
10 ก	ผลการทดสอบพหุสมการพหุคูณพหุคูณของงบประมาณค่าใช้จ่ายของรัฐบาลของ ประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ Level $I(0)$ โดยกำหนดค่าให้ไม่ มีค่าคงที่และแนวโน้มเวลา (None)	90
11 ก	ผลการทดสอบพหุสมการพหุคูณพหุคูณของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของ ประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ First differential $I(1)$ โดย กำหนดค่าให้ไม่มีค่าคงที่และแนวโน้มเวลา (None)	91
12 ก	ผลการทดสอบพหุสมการพหุคูณพหุคูณของงบประมาณค่าใช้จ่ายของรัฐบาลของ ประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ที่ระดับ First Differential $I(1)$ โดย กำหนดค่าให้ไม่มีค่าคงที่และแนวโน้มเวลา (None)	92
1 ข	ผลการทดสอบพหุสมการพหุคูณพหุคูณของแบบจำลองความสัมพันธ์ ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ ของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ด้วยวิธี Pedroni with intercept	93
2 ข	ผลการทดสอบพหุสมการพหุคูณพหุคูณของแบบจำลองความสัมพันธ์ ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ ของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ด้วยวิธี Pedroni with intercept and trend	94
3 ข	ผลการทดสอบพหุสมการพหุคูณพหุคูณของแบบจำลองความสัมพันธ์ ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ ของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ด้วยวิธี Pedroni with none	95
4 ข	ผลการทดสอบพหุสมการพหุคูณพหุคูณของแบบจำลองความสัมพันธ์ ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ ของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ด้วยวิธี Kao	96
1 ค	ผลการทดสอบสมการพหุสมการพหุคูณด้วยวิธี Redundant Fixed Effects Test	97
2 ค	ผลการทดสอบสมการพหุสมการพหุคูณด้วยวิธี Huasman Test	98
3 ค	ผลการทดสอบสมการพหุสมการพหุคูณด้วยวิธี Lagrange Multiplier Test (LM-Test)	99

1 ง	ผลการประมาณความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับ ผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ แบบ Cross-section Random Effects ด้วยวิธี OLS-Estimator	100
2 ง	ผลการประมาณความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับ ผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ แบบ Cross-section Random Effects ด้วยวิธี DOLS-Estimator	101
3 ง	ผลการประมาณความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับ ผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ แบบ Cross-section Fixed Effects ด้วยวิธี GMM-Estimator	102
4 ง	ผลการประมาณความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับ ผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ แบบ Cross-section Fixed Effects ด้วยวิธี OLS-Estimator แบบ Random Effect รายประเทศ	103
5 ง	ผลการประมาณความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับ ผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ แบบ Cross-section Fixed Effects ด้วยวิธี DOLS-Estimator แบบ Random Effect รายประเทศ	103
6 ง	ผลการประมาณความสัมพันธ์ระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับ ผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ แบบ Cross-section Fixed Effects ด้วยวิธี GMM-Estimator แบบ Random Effect รายประเทศ	103
1 จ	ผลการหาความสัมพันธ์เชิงคุณภาพระยะสั้นด้วยวิธี OLS-Estimator	104
2 จ	ผลการหาความสัมพันธ์เชิงคุณภาพระยะสั้นด้วยวิธี DOLS-Estimator	105
3 จ	ผลการหาความสัมพันธ์เชิงคุณภาพระยะสั้นด้วยวิธี GMM-Estimator	106
1 ฉ	ผลการประมาณความสัมพันธ์ระยะยาวระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่าย รัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชีย ตะวันออกเฉียงใต้	107
2 ฉ	ผลการทดสอบความนิ่งจากส่วนที่เหลือ (Residual) จากการประมาณ ความสัมพันธ์ระยะยาวระหว่างงบประมาณค่าใช้จ่ายรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์ มวลรวมภายในประเทศของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้	108

