

สารบัญ

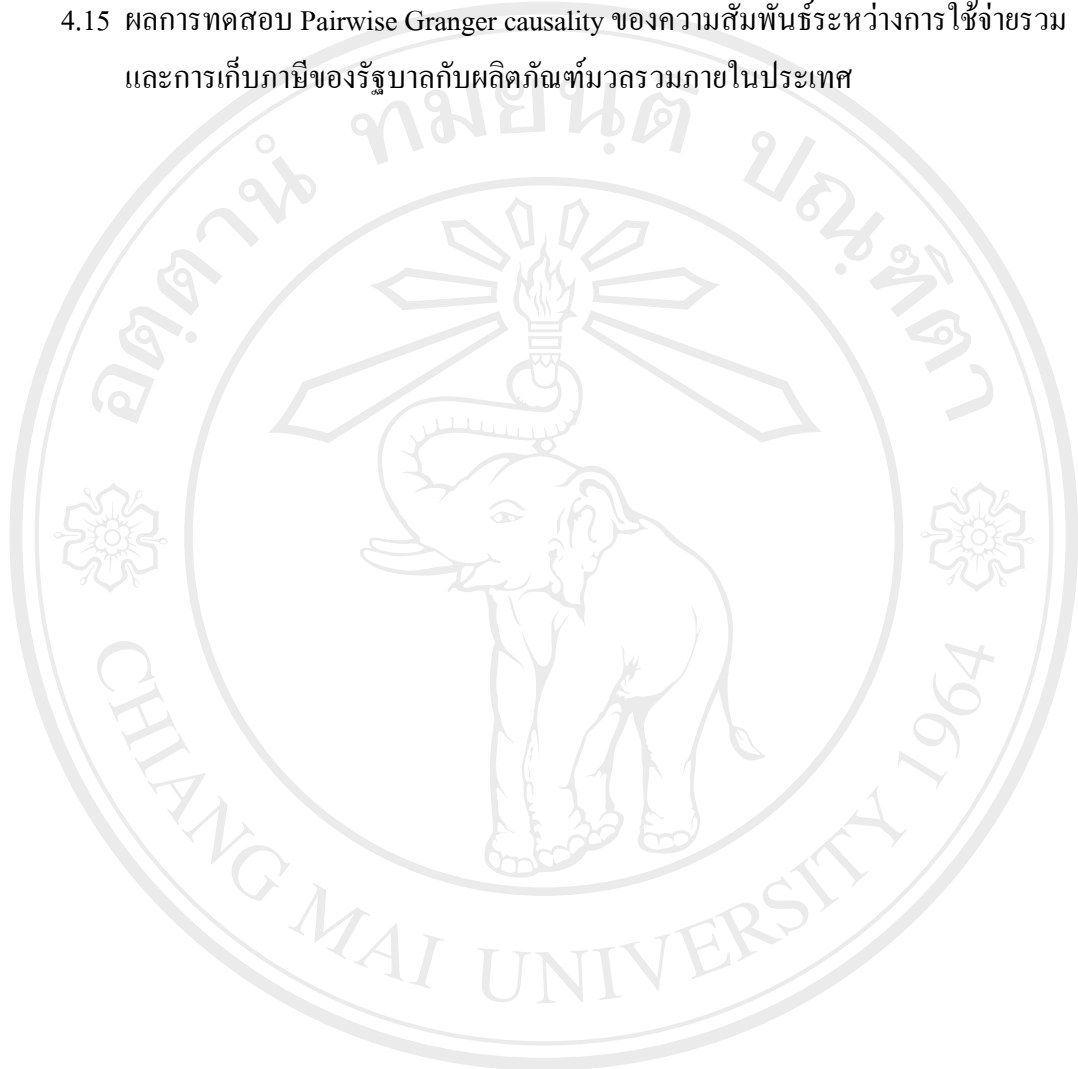
	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ก
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ญ
สารบัญภาพ	ฎ
สารบัญตารางภาคผนวก	ฐ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	3
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับการศึกษา	4
1.4 ขอบเขตการศึกษา	4
1.5 นิยามศัพท์เฉพาะ	4
บทที่ 2 แนวคิด ทฤษฎี และผลงานการศึกษาที่เกี่ยวข้อง	
2.1 แนวคิดและทฤษฎีที่ใช้ในการศึกษา	5
2.1.1 แนวคิดเชิงทฤษฎีเกี่ยวกับการคลังสาธารณะ	5
2.1.2 นโยบายการคลังในแบบจำลองของรายจ่ายมวลรวมของเคนส์	14
2.1.3 การวิเคราะห์ดุลยภาพแบบสภาพนิ่งในแบบจำลองรายได้ประชาชาติ	16
2.1.4 แนวคิดและวิธีการทางเศรษฐมิติ	18
2.2 ผลงานการศึกษาที่เกี่ยวข้อง	29
บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย	
3.1 แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา	34
3.2 สมมติฐานที่ใช้ในการศึกษา	37
3.3 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	37
3.4 วิธีการศึกษา	38

บทที่ 4 ผลการศึกษา	
4.1 นโยบายการคลัง	40
4.1.1 รายจ่ายของรัฐบาล	40
4.1.2 รายรับของรัฐบาล	42
4.2 ผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ	46
4.3 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	48
4.4 ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล	50
4.5 ผลการทดสอบ Cointegration Vectors และ Error Correction Mechanism(ECM)	52
4.6 ผลการทดสอบต้นเหตุด้วยวิธี Granger Causality test	60
บทที่ 5 สรุปและข้อเสนอแนะ	
5.1 สรุปผลการศึกษา	65
5.2 ข้อเสนอแนะ	67
เอกสารอ้างอิง	68
ภาคผนวก	
ภาคผนวก ก ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	72
ภาคผนวก ข ผลการทดสอบ Unit root	76
ภาคผนวก ค ผลการเลือกค่าความล่าช้าที่เหมาะสม	83
ภาคผนวก ง ผลการทดสอบ Cointegration ในรูปแบบสมการต่างๆ	84
ภาคผนวก จ ผลการประมาณค่า Cointegration vectors	94
ภาคผนวก ฉ ผลการทดสอบ error correction mechanism	95
ประวัติผู้เขียน	98

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
1.1 สัดส่วนของการใช้จ่าย (G) และการเก็บภาษีของรัฐบาล (T) ต่อผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ (GDP) ในระหว่างปี พ.ศ. 2536 – 2547	3
3.1 การทดสอบสมมติฐานในการหาจำนวน cointegrating vectors	26
4.1 มูลค่ารายจ่ายรายปีของรัฐบาลระหว่างปี พ.ศ. 2539 – 2547	41
4.2 โครงสร้างทางด้านรายรับของรัฐบาลระหว่างปี พ.ศ. 2539 – 2546	43
4.3 มูลค่าการเก็บภาษีของรัฐบาลในปี พ.ศ. 2539 – 2546	44
4.4 ผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศคำนวณทางด้านรายจ่ายระหว่างปี พ.ศ. 2536–2547	46
4.5 ข้อมูลรายไตรมาสที่ใช้ในการศึกษา ตั้งแต่ปี พ.ศ. 2539 – 2547	48
4.6 ผลการทดสอบ unit roots ของข้อมูลในแบบจำลองที่ใช้ในการศึกษาที่ระดับ level; $I(0)$ ในสมการรูปแบบต่างๆ	51
4.7 ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูลที่ระดับ first difference; $I(1)$ ในสมการรูปแบบต่างๆ	52
4.8 ผลการ lag length ของแบบจำลอง VAR แสดงความสัมพันธ์ระหว่างการใช้จ่ายและมูลค่าการเก็บภาษีของรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ	53
4.9 ผลการทดสอบหารูปแบบสมการ cointegrating vector ที่เหมาะสมของแบบจำลอง แสดงความสัมพันธ์ระหว่างการใช้จ่ายและการเก็บภาษีของรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ	54
4.10 ผลการทดสอบสมมติฐานการหาจำนวน cointegrating vectors ของแบบจำลอง แสดงความสัมพันธ์ระหว่างการใช้จ่ายและการเก็บภาษีของรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ	55
4.11 การประมาณค่าของ cointegrating vectors ของแบบจำลองแสดงความสัมพันธ์ระหว่างการใช้จ่ายและการเก็บภาษีของรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ	57
4.12 ผลการทดสอบ error correction mechanism ของแบบจำลองแสดงความสัมพันธ์ระหว่างการใช้จ่ายและการเก็บภาษีของรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ	58
4.13 ผลการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผลระหว่างการใช้จ่ายของรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ กำหนดค่า lag เท่ากับ 1	61

- 4.14 ผลการทดสอบความเป็นเหตุเป็นผลระหว่างการเก็บภาษีของรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์
มวลรวมภายในประเทศ กำหนดค่า lag เท่ากับ 1 62
- 4.15 ผลการทดสอบ Pairwise Granger causality ของความสัมพันธ์ระหว่างการใช้จ่ายรวม
และการเก็บภาษีของรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ 63



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบัญภาพ

รูป	หน้า	
1.1	มูลค่าผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ การเก็บภาษี และการใช้จ่ายของรัฐบาล	2
2.1	ความสัมพันธ์ทางเศรษฐกิจระหว่างภาครัฐบาลและเอกชน	6
2.2	การใช้นโยบายการคลังของรัฐบาลเพื่อให้เกิดการจ้างงานเต็มที่	15
4.1	มูลค่ารายจ่ายรายปีของรัฐบาลระหว่างปี พ.ศ. 2539 – 2547	42
4.2	มูลค่ารายรับของรัฐบาลระหว่างปี พ.ศ. 2539 – 2546	43
4.3	มูลค่าการเก็บภาษีของรัฐบาลในปี พ.ศ. 2539 – 2546	45
4.4	มูลค่าผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศที่คำนวณทางด้านรายจ่ายในปีพ.ศ.2536–2547	47
4.5	มูลค่าของการเก็บภาษี การใช้จ่ายของรัฐบาลเพื่อการดำเนินงานปกติและการใช้จ่ายของรัฐบาลเพื่อการลงทุน ระหว่างไตรมาสที่ 1 พ.ศ. 2539 ถึงไตรมาสที่ 3 พ.ศ. 2547	50

สารบัญตารางภาคผนวก

ตาราง	หน้า
ก – 1 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	72
ก – 2 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา (เพิ่มเติม)	74
ข – 1 ผลการทดสอบ Unit root ของข้อมูลผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ ณ ระดับ I(1) ที่ระดับ first differences with Trend and Intercept โดย lag length เท่ากับ 7	76
ข – 2 ผลการทดสอบ Unit root ของข้อมูลการลงทุนของภาคเอกชน ณ ระดับ I(1) ที่ระดับ first differences with Trend and Intercept โดย lag length เท่ากับ 2	77
ข – 3 ผลการทดสอบ Unit root ของข้อมูลการเก็บภาษีของรัฐบาล ณ ระดับ I(1) ที่ระดับ first differences with Trend and Intercept โดย lag length เท่ากับ 8	78
ข – 4 ผลการทดสอบ Unit root ของข้อมูลการใช้จ่ายของรัฐบาล ณ ระดับ I(1) ที่ระดับ first differences without Trend and Intercept โดย lag length เท่ากับ 2	79
ข – 5 ผลการทดสอบ Unit root ของข้อมูลการส่งออก ณ ระดับ I(1) ที่ระดับ first differences without Trend and Intercept โดย lag length เท่ากับ 0	80
ข – 6 ผลการทดสอบ Unit root ของข้อมูลการนำเข้า ณ ระดับ I(1) ที่ระดับ first differences without Trend and Intercept โดย lag length เท่ากับ 0	81
ข – 7 ผลการทดสอบ Unit root ของข้อมูลปริมาณเงินในระบบเศรษฐกิจ ณ ระดับ I(1) ที่ระดับ first differences without Trend and Intercept โดย lag length เท่ากับ 0	82
ค – 1 ผลการเลือกค่า lag length ในแบบจำลองทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างรายจ่ายของรัฐบาลและการเก็บภาษีของรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ	83
ง – 1 การทดสอบสมการ Cointegration with no intercepts or trends in the VAR ในแบบจำลองทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างรายจ่ายของรัฐบาลและการเก็บภาษีของรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ	84
ง – 2 การทดสอบสมการ Cointegration with restricted intercepts and no trends in the VAR ในแบบจำลองทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างรายจ่ายของรัฐบาลและการเก็บภาษีของรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ	86

ง – 3	การทดสอบสมการ Cointegration with unrestricted intercepts and no trends in the VAR ในแบบจำลองทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างรายจ่ายของรัฐบาล และการเก็บภาษีของรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ	88
ง – 4	การทดสอบสมการ Cointegration with unrestricted intercepts and restricted trends in the VAR ในแบบจำลองทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างรายจ่ายของรัฐบาล และการเก็บภาษีของรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ	90
ง – 5	การทดสอบสมการ Cointegration with unrestricted intercepts and unrestricted trends in the VAR ในแบบจำลองทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างรายจ่ายของรัฐบาล และการเก็บภาษีของรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ	92
จ – 1	ผลการประมาณค่าของ cointegrating vectors ของแบบจำลองแสดงความสัมพันธ์ ระหว่างการใช้จ่ายและการเก็บภาษีของรัฐบาลกับการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจ	94
ฉ – 1	ผลการทดสอบ error correction mechanism ของแบบจำลองแสดงความสัมพันธ์ ระหว่างการใช้จ่ายและการเก็บภาษีของรัฐบาลกับการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจ	95