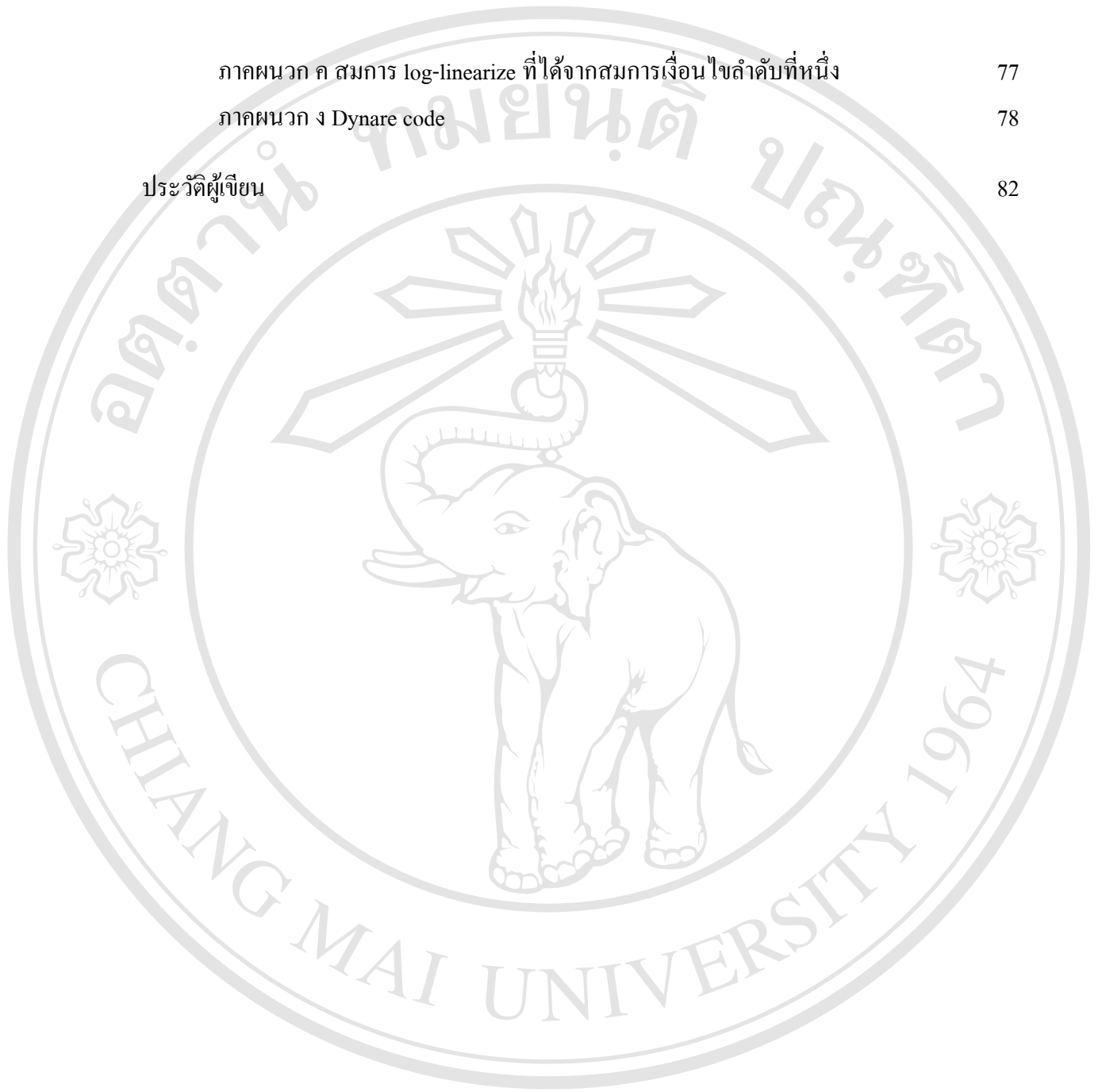


สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ก
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	จ
สารบัญตาราง	ญ
สารบัญภาพ	ฉ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	3
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา	4
1.4 ขอบเขตของการศึกษา	4
1.5 นิยามศัพท์	4
บทที่ 2 กรอบแนวคิดทางทฤษฎีและเอกสารที่เกี่ยวข้อง	
2.1 แนวคิดและทฤษฎีทางเศรษฐศาสตร์มหภาค	5
2.1.1 ทฤษฎีวิวัจจักรธุรกิจที่แท้จริง (Real Business Cycle Theory : RBC)	5
2.1.2 ทฤษฎีวิวัจจักรธุรกิจนิวเคนส์เซียน (New Keynesian Business Cycle Theory)	13
2.1.3 การสะสมพฤติกรรมการบริโภค (Habit Formation for Consumption)	15
2.1.4 ต้นทุนของการปรับตัวในการลงทุน (Investment Adjustment Cost : IAC)	17
2.1.5 แนวคิดแบบดั้งเดิม (Traditional) และริคาร์ดีเยน (Ricardian)	
ต่อหน้าสาธารณะ	18
2.2 แนวคิดและทฤษฎีทางเศรษฐมิติ (Econometric Theory)	20
2.2.1 ทฤษฎีของเบย์ (Bayes' Theorem)	20
2.2.2 มาร์คอฟเชนมอนติคาร์โล (Markov Chain Monte Carlo: MCMC)	22
2.3 เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	23

บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย	
3.1 แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา	30
3.1.1 ภาคครัวเรือน	30
3.1.2 ภาคธุรกิจ	32
3.1.3 ภาครัฐบาล	33
3.1.4 คุณภาพของตลาด	34
3.2 วิธีการวิจัย	35
3.2.1 โครงสร้างของแบบจำลองและวิธีแก้ปัญห (Model construction and solution)	35
3.2.2 การวิเคราะห์ปฏิกิริยาตอบสนอง (Impulse Response Function : IRF)	39
3.2.3 การประมาณแบบจำลองด้วยวิธีการเบย์เซียน (Bayesian approach)	40
3.3 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	43
3.4 พารามิเตอร์ที่ถูกหาค่า (Calibrated parameter)	44
3.5 การแจกแจงก่อนหน้า (Prior distributions)	44
3.6 การหาค่าการแจกแจงภายหลัง (Posterior distributions)	47
3.7 สรุปขั้นตอนของวิธีการศึกษา	50
บทที่ 4 ผลการศึกษา	
4.1 วิเคราะห์ค่าสัมประสิทธิ์ของการแจกแจงภายหลัง (Posterior parameters)	53
4.2 การวิเคราะห์ปฏิกิริยาตอบสนอง (Impulse Response Functions: IRFs)	57
บทที่ 5 สรุปผลและข้อเสนอแนะ	
5.1 สรุปผลการศึกษา	61
5.2 ข้อเสนอแนะด้านนโยบาย	62
5.3 ข้อเสนอแนะสำหรับการศึกษาค้างต่อไป	64
เอกสารอ้างอิง	65
ภาคผนวก	
ภาคผนวก ก เงื่อนไขลำดับหนึ่งของแบบจำลอง	69
ภาคผนวก ข สถานะคงตัวของแบบจำลอง	74

ภาคผนวก ค สมการ log-linearize ที่ได้จากสมการเงื่อนไขลำดับที่หนึ่ง	77
ภาคผนวก ง Dynare code	78
ประวัติผู้เขียน	82



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบัญตาราง

ตาราง		หน้า
2.1	สรุปเอกสารและงานวิจัยการศึกษาการวิเคราะห์ผลกระทบทางเศรษฐกิจจากการเปลี่ยนแปลงอย่างฉับพลันในเครื่องมือทางการคลัง	27
3.1	ค่าเฉลี่ยและการกระจายของค่าพารามิเตอร์ก่อนหน้า	45
4.1	แสดงค่าการแจกแจงก่อนหน้าและการแจกแจงภายหลังของค่าพารามิเตอร์	53
4.2	แสดงค่าการแจกแจงก่อนหน้าและการแจกแจงภายหลังของกระบวนการเปลี่ยนแปลง (Shocks process)	56

สารบัญภาพ

รูป		หน้า
1.1	การใช้จ่ายของรัฐบาลกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ	2
1.2	หนี้สาธารณะต่อผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ	3
2.1	ความผันผวนของผลผลิตและการจ้างงานที่เป็นผลมาจากการเปลี่ยนแปลงอย่างฉับพลันทางเทคโนโลยี	8
2.2	แบบจำลอง IS-LM กับระดับราคาที่มีความยืดหยุ่นสูง	10
2.3	แบบจำลองวัฏจักรธุรกิจที่แท้จริงที่รวมอุปสงค์มวลรวมและอุปทานมวลรวม	10
2.4	ผลกระทบด้านเทคโนโลยี	12
2.5	ผลกระทบของการเปลี่ยนแปลงอย่างฉับพลันทางด้านการใช้จ่ายของรัฐบาล	13
2.6	ผลกระทบการเกิดการเปลี่ยนแปลงอย่างฉับพลันของอุปสงค์มวลรวมในแบบจำลองนิวเคนส์เซียน	15
2.7	ผลกระทบของการลดภาษี	19
3.1	ขั้นตอนการทำงานของ Metropolis Hasting (MH) ในการสร้างการแจกแจงภายหลัง	50
3.2	ขั้นตอนของวิธีการศึกษาเพื่อประมาณค่าพารามิเตอร์และวิเคราะห์ผลกระทบที่เกิดจากตัวแปรภายนอกที่มีต่อตัวแปรภายใน	51
4.1	ผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงอย่างฉับพลันในการเพิ่มการใช้จ่ายของรัฐบาล	57
4.2	ผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงอย่างฉับพลันในการเพิ่มภาษีมูลค่าเพิ่มสำหรับสินค้าทุน	58
4.3	ผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงอย่างฉับพลันในการเพิ่มภาษีเงินได้บุคคลธรรมดา	59
4.4	ผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงอย่างฉับพลันในการเพิ่มภาษีมูลค่าเพิ่ม	60
4.5	ผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงอย่างฉับพลันในการเพิ่มเงินโอนของรัฐบาล	60
5.1	เปรียบเทียบการเก็บภาษีที่ส่งผลกระทบต่อผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ	63