

สารบัญ

หน้า

กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญ	ช
สารบัญตาราง	ฅ
สารบัญภาพ	ญ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	3
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา	3
1.4 ขอบเขตของการศึกษา	4
1.5 นิยามศัพท์	4
บทที่ 2 กรอบแนวคิดทางทฤษฎีและเอกสารที่เกี่ยวข้อง	
2.1 แนวคิดและทฤษฎีทางเศรษฐศาสตร์มหภาค	5
2.1.1 แบบจำลองแบบจำลองวัฏจักรธุรกิจที่แท้จริง (Real Business Cycle: RBC)	6
2.1.2 แบบจำลองนิวเคนส์เซียน (New Keynesian Model)	12
2.1.3 ต้นทุนของการปรับตัวของสินค้าทุน (Adjustment cost for capital)	24
2.1.4 การสะสมพฤติกรรม (Habit Formation for Consumption)	25
2.1.5 กฎของเทย์เลอร์ (Taylor rule)	27
2.2 แนวคิดและทฤษฎีทางเศรษฐมิติ	28
2.2.1 ทฤษฎีของเบย์ (Bayes' Theorem)	28
2.2.2 มาร์คอฟเชนมอนติคาร์โล (Markov Chain Monte Carlo: MCMC)	30
2.3 เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	33

บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย	
3.1 แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา	41
3.2 วิธีการวิจัย	49
3.3 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	60
3.4 พารามิเตอร์ที่ถูกลำค่า (Calibrated parameter)	61
3.5 การแจกแจงก่อนหน้า (Prior distributions)	63
3.6 การหาค่าการแจกแจงภายหลัง (Posterior distributions)	66
3.7 ขั้นตอนในการศึกษาโดยสรุป	68
บทที่ 4 ผลการศึกษา	
4.1 วิเคราะห์ค่าสัมประสิทธิ์ของการแจกแจงภายหลัง (Posterior parameters)	71
4.2 การวิเคราะห์ปฏิกิริยาตอบสนอง (Impulse Response Functions: IRFs)	75
4.3 ผลการวิเคราะห์การแยกส่วนของความแปรปรวน (Variance decomposition)	81
บทที่ 5 สรุปผลและข้อเสนอแนะ	
5.1 สรุปผลการศึกษา	83
5.2 ข้อเสนอแนะเชิงนโยบาย	84
5.3 ข้อเสนอแนะสำหรับการศึกษากครั้งต่อไป	85
บรรณานุกรม	86
ภาคผนวก	
ภาคผนวก ก เงื่อนไขลำดับหนึ่งของแบบจำลอง	91
ภาคผนวก ข สถานะคงตัวของแบบจำลอง	122
ภาคผนวก ค Dynare code	141
ประวัติผู้เขียน	152

สารบัญตาราง

ตาราง		หน้า
2.1	สรุปเอกสารและงานวิจัยการศึกษาการวิเคราะห์ผลกระทบทางเศรษฐกิจจากการเปลี่ยนแปลงในตลาดที่อยู่อาศัย	37
3.1	ค่าพารามิเตอร์ที่กำหนดให้คงที่	62
3.2	ค่าเฉลี่ยและการกระจายของค่าพารามิเตอร์ก่อนหน้า	64
4.1	ค่าการแจกแจงก่อนหน้าและการแจกแจงภายหลังของค่าพารามิเตอร์	71
4.2	ค่าการแจกแจงก่อนหน้าและการแจกแจงภายหลังของกระบวนการเปลี่ยนแปลง (Shocks process)	74
4.3	ค่าการแยกส่วนของความแปรปรวน	81

สารบัญภาพ

รูป		หน้า
1.1	ดัชนีราคาบ้านและมูลค่าผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของไทย ตั้งแต่ปี พ.ศ. 2534 ถึงปี พ.ศ. 2553	1
2.1	การเปลี่ยนแปลงด้านเทคโนโลยีต่อฟังก์ชันการผลิต	8
2.2	การปรับตัวแบบพลวัตรของระบบเศรษฐกิจเมื่อเกิดการเปลี่ยนแปลงด้านเทคโนโลยี	9
2.3	การปรับตัวของอัตราดอกเบี้ยที่แท้จริงจากการเปลี่ยนแปลงด้านเทคโนโลยี	11
2.4	การปรับตัวของอัตราค่าจ้างที่เป็นเงินจากการใช้นโยบายเงิน	14
2.5	การปรับของระดับราคาภายใต้ตลาดกึ่งแข่งขันกึ่งผูกขาด	15
2.6	กำไรที่ได้รับของหน่วยธุรกิจ จากการเปลี่ยนแปลงระดับอุปสงค์ในตลาดกึ่งแข่งขันกึ่งสมบูรณ์	16
2.7	การกำหนดอัตราค่าจ้างที่แท้จริงภายใต้ทฤษฎีค่าจ้างตามประสิทธิภาพ	19
2.8	การกำหนดอัตราค่าจ้างที่แท้จริงภายใต้ทฤษฎีการกำหนดค่าจ้างโดยผู้อยู่ในสหภาพแรงงาน	20
2.9	ผลกระทบโดยรวมของเศรษฐกิจจากการเปลี่ยนแปลงด้านอุปสงค์ภายใต้แนวคิดของสำนักนิวเคนส์เซียน	22
2.10	การปรับตัวของระดับราคาและผลผลิตจากการเกิดสภาวะเศรษฐกิจตกต่ำ	23
3.1	ความสัมพันธ์ของหน่วยเศรษฐกิจในแบบจำลอง	41
3.2	ขั้นตอนการศึกษาในการวิเคราะห์และประมาณค่าพารามิเตอร์ในแบบจำลอง	49
3.3	กระบวนการการทำงานของ Metropolis Hasting (MH) ในการสร้างการแจกแจงภายหลัง	68
3.4	ขั้นตอนวิธีการศึกษาโดยสรุป	70
4.1	ผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงทางด้านเทคโนโลยีของภาคการผลิตที่อยู่อาศัย	76
4.2	ผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงด้านความชื่นชอบในที่อยู่อาศัย	78
4.3	ผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงทางด้านนโยบายการเงิน	80