

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ก
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	จ
สารบัญตาราง	ช
สารบัญภาพ	ฉ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	5
1.3 ประโยชน์ที่ได้รับจากการศึกษา	5
1.4 ขอบเขตการศึกษา	5
1.5 นิยามศัพท์	5
บทที่ 2 ทบทวนวรรณกรรม	
2.1 แนวคิดและทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง	7
2.1.1 ทฤษฎีเศรษฐศาสตร์มหภาค (Macroeconomic Theory)	7
2.1.2 ทฤษฎีทางเศรษฐมิติ (Econometric Theory)	23
2.2 เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	28
2.2.1 ความสัมพันธ์ของราคาน้ำมัน การดำเนินนโยบายการเงิน และความผันผวนในระบบเศรษฐกิจ	28
2.2.2 พัฒนาการของแบบจำลองเศรษฐศาสตร์มหภาคที่ใช้ทำการศึกษา	30
บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย	
3.1 แบบจำลอง	38
3.2 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	44
3.3 วิธีการศึกษา	45
3.3.1 การหาระบบสมการเพื่อใช้ในการศึกษา	45

3.3.2 การแก้แบบจำลองด้วยวิธีการคาดการณ์เชิงเส้นตรงอย่างมีเหตุผล (Linear Rational Expectation)	45
3.3.3 การประมาณค่าพารามิเตอร์ของแบบจำลองด้วยเทคนิคเบย์เซียน (Bayesian)	51
บทที่ 4 ผลการศึกษา	
4.1 ผลการประมาณค่าพารามิเตอร์	60
4.2 การวิเคราะห์การตอบสนองของตัวแปรเศรษฐกิจมหภาคต่อ การเปลี่ยนแปลงฉับพลัน	62
4.2.1 การเปลี่ยนแปลงฉับพลันในนโยบายการเงิน	62
4.2.2 การเปลี่ยนแปลงฉับพลันในราคาน้ำมันโดยเปรียบเทียบ	63
บทที่ 5 สรุปผลและข้อเสนอแนะ	
5.1 สรุปผลการศึกษา	65
5.2 ข้อเสนอแนะจากการศึกษา	66
บรรณานุกรม	67
ภาคผนวก	
ภาคผนวก ก วิธีการล็อก ลิเนียร์	71
ภาคผนวก ข การหาสมการเงื่อนไขลำดับที่หนึ่งของตัวแทนในระบบเศรษฐกิจ และการหาสมการเส้นโค้งฟิลลิปส์ตามแนวคิดนิวเคนส์เซียน	73
ภาคผนวก ค Dynare code	80
ประวัติผู้เขียน	83

สารบัญตาราง

ตาราง		หน้า
1.1	การใช้ การผลิต การนำเข้าพลังงานเชิงพาณิชย์ขั้นต้นของประเทศไทย	1
2.1	สรุปเอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้องกับการศึกษา	32
3.1	การระบุการแจกแจงก่อนหน้า	52
4.1	การแจกแจงภายหลัง	61

สารบัญภาพ

รูป	หน้า	
1.1	ดัชนีราคาน้ำมันดิบเฉลี่ยรายปี และผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศของไทย	2
1.2	อัตราดอกเบี้ยซื้อคืนพันธบัตร 1 วันเฉลี่ยรายปี และผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ	3
1.3	อัตราเงินเฟ้อพื้นฐาน อัตราเงินเฟ้อทั่วไปและดัชนีราคาน้ำมันดิบเฉลี่ยรายปี	4
1.4	วัฏจักรธุรกิจ	6
2.1	ความผันผวนของผลผลิตและการจ้างงานที่เกิดจากการปรับปรุงเทคโนโลยี	10
2.2	แบบจำลอง IS-LM ภายใต้ระดับราคาที่ยืดหยุ่นสมบูรณ์	11
2.3	วัฏจักรธุรกิจจริงในแบบจำลองอุปสงค์รวมและอุปทานรวม	12
2.4	ผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงอุปสงค์ในเทคโนโลยี	13
2.5	ผลกระทบจากการปรับปรุงเทคโนโลยีชั่วคราว และถาวรในแบบจำลองวัฏจักรธุรกิจจริง	14
2.6	การปรับตัวของราคาภายใต้ตลาดแข่งขันไม่สมบูรณ์	16
2.7	ต้นทุนเมนูและการปรับตัวของราคา	17
2.8	ค่าจ้างแรงงานแท้จริงตามประสิทธิภาพการทำงาน และเงื่อนไขของ Solow	19
2.9	การว่างงานโดยไม่สมัครใจในแบบจำลองค่าจ้างตามประสิทธิภาพ	20
2.10	ผลจากการลดลงอุปสงค์ในอุปสงค์รวมในแบบจำลองนิวเคนส์เซียน	22
3.1	กระบวนการสร้างรูปแบบการแจกแจงภายหลัง	58
3.2	สรุปวิธีการศึกษา	59
4.1	การตอบสนองของตัวแปรทางเศรษฐกิจมหภาคต่อ การเปลี่ยนแปลงอุปสงค์ในนโยบายการเงิน	62
4.2	การตอบสนองของตัวแปรทางเศรษฐกิจมหภาคต่อ การเปลี่ยนแปลงอุปสงค์ในราคาน้ำมัน	64