

ชื่อเรื่องวิทยานิพนธ์

ผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงจับปล้นในราคาน้ำมัน
และนโยบายการเงินต่อตัวแปรเศรษฐกิจมหภาคของ
ไทย

ผู้เขียน

นายจิระยุทธ สารบุตร

ปริญญา

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์

อ.ดร.ประพัฒน์ จริยะพันธุ์

อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก

ผศ.ดร. ไพรัช กาญจนการุณ

อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

ผศ.ดร. นิติต พันธมิตร

อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

บทคัดย่อ

วัตถุประสงค์ของการศึกษาครั้งนี้เพื่อวิเคราะห์ผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลง
จับปล้นในราคาน้ำมัน และนโยบายการเงินต่อตัวแปรเศรษฐกิจมหภาคของไทยโดยใช้แบบจำลอง
ดุลยภาพทั่วไปพลวัตเชิงสุ่ม ค่าพารามิเตอร์ถูกประมาณค่าด้วยเทคนิคเบย์เซียน ข้อมูลที่ใช้ใน
การศึกษาเป็นข้อมูลรายไตรมาส ตั้งแต่ปี พ.ศ. 2544 ถึงปี พ.ศ. 2553

ผลการศึกษาพบว่า การเปลี่ยนแปลงจับปล้นในราคาน้ำมันส่งผลกระทบต่อระบบ
เศรษฐกิจผ่านทางด้านอุปทาน มีผลให้เกิดการหดตัวของผลผลิตจริง ค่าจ้างแท้จริงลดลง การ
คาดการณ์อัตราเงินเฟ้อและอัตราดอกเบี้ยเพิ่มสูงขึ้น ขณะที่การเปลี่ยนแปลงจับปล้นในนโยบาย
การเงินส่งผลกระทบต่อระบบเศรษฐกิจผ่านทางด้านอุปสงค์ ทำให้เกิดการลดลงของผลผลิตจริง ค่าจ้าง
แท้จริงและการคาดการณ์อัตราเงินเฟ้อลดลง

Thesis Title Effects of Oil Price and Monetary Policy Shock on
Thai Macroeconomic Variables

Author Mr. Chirayut Saraboot

Degree Master of Economics

Thesis Advisory Committee

Dr. Prapatchon Jariyapan	Advisor
Asst. Prof. Dr. Pairut Kanjanakaroon	Co - advisor
Asst. Prof. Dr. Nisit Panthamit	Co - advisor

ABSTRACT

The objective of this study is to analyze the effects of oil price and monetary policy shock on Thailand's macroeconomic variables using the Dynamic Stochastic General Equilibrium Model. Parameters were estimated using Bayesian techniques. Quarterly data from 2001 to 2010 were used in this study.

The results show that oil price shock affected the supply side of the economy. It led to the contraction of real output and a decrease in real wage as well as the increase in expected inflation rate and an increase in the interest rate. The study also revealed that monetary policy shock affected the demand side of the economy. It caused a reduction in real output and a decline in real wage and a lower expected inflation rate.