

ตัวแบบเพื่อการพยากรณ์เศรษฐกิจมหภาค

เครื่องมือที่ใช้ในการวิเคราะห์ที่สำคัญของนักเศรษฐศาสตร์ประกอบด้วย

1. สมการเศรษฐกิจและสมการอนุกรมเวลาอย่างง่าย เช่น การใช้ดัชนีชี้เส้นทางเศรษฐกิจ และการใช้ข้อมูลในอดีตโดยสมการ ARIMA เป็นต้น
2. แบบจำลองสำเร็จรูปในลักษณะ Spreadsheet Model เช่น Oxford Global Model และ IMF Financial Programming เป็นต้น
3. แบบจำลองเศรษฐกิจมหภาคขนาดใหญ่ เช่น แบบจำลองของธนาคารแห่งประเทศไทย (BOTMM) และแบบจำลองของสถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์ (NIDA Macro Model) เป็นต้น
4. ค่าเฉลี่ยการพยากรณ์ที่ได้จากการสำรวจการของผู้เชี่ยวชาญ (Survey of professional forecast) หรือที่เรียกว่า Consensus Forecast เช่น ผลการสำรวจโดย Reuters และ ผลการสำรวจโดยเว็บไซต์ consensuseconomics.com เป็นต้น

โดยทั่วไป การพยากรณ์โดยใช้สมการอย่างง่ายและการใช้แบบจำลองขนาดใหญ่มีข้อดี-ข้อเสียที่แตกต่างกันดังนี้

1. **ตัวแบบขนาดใหญ่** จะมีการกำหนดโครงสร้างความสัมพันธ์ระหว่างตัวแปรต่างๆ ในแบบจำลองให้สอดคล้องกับทฤษฎีทางเศรษฐศาสตร์ และใช้วิธีการทางเศรษฐกิจในการประมาณค่า หรือใช้วิธีการ Computable General Equilibrium (CGE) ในการคำนวณความสัมพันธ์

ข้อดี แบบจำลองสามารถอธิบายความเชื่อมโยงของตัวแปรต่าง ๆ ได้ดีและสามารถใช้ในการประเมินผลกระทบจากปัจจัยภายนอก และผลกระทบเชิงนโยบายที่สำคัญได้ เช่น ผลจากการปรับเพิ่มอัตราดอกเบี้ยในสหรัฐฯ ผลของการเพิ่มขึ้นของราคาน้ำมันดิบในตลาดโลก ผลของการปรับค่าจ้างแรงงานขั้นต่ำ หรือผลของการปรับเพิ่มดอกเบี้ยนโยบายการเงิน

ข้อเสีย มีลักษณะที่ซับซ้อน ทำให้มีต้นทุนสูงทั้งในการสร้างและดูแลรักษาแบบจำลอง เนื่องจากจำเป็นต้องใช้ฐานข้อมูลขนาดใหญ่ และอาศัยทีมงานนักวิจัยในการเก็บข้อมูล ประมาณค่าความสัมพันธ์ และตรวจสอบความเหมาะสมของแบบจำลอง นอกจากนี้เนื่องจากปัจจัยดังกล่าวข้างต้น จึงทำให้ต้องอาศัยเวลาในการวิเคราะห์และประมาณค่า ทำให้ไม่สามารถปรับปรุงผลการพยากรณ์ได้บ่อยเท่ากับตัวแบบที่มีขนาดเล็ก

2. **ตัวแบบขนาดเล็ก** ประกอบด้วยสมการเดียวหรือเป็นระบบสมการ ที่มีจำนวนตัวแปรไม่มากนักโดยอาศัยหลักการทางสถิติหรือเศรษฐมิติในระดับเบื้องต้นในการคำนวณความสัมพันธ์ซึ่งแบบจำลองลักษณะนี้มักมีการนำมาใช้ในสถาบันการเงินต่าง ๆ

ข้อดีมีต้นทุนที่ไม่สูงในการสร้างและดูแลรักษาแบบจำลอง และมีความยืดหยุ่นในการเพิ่ม-ลดตัวแปรในแบบจำลองให้สอดคล้องกับสถานการณ์เศรษฐกิจในแต่ละช่วงเวลา ตลอดจนการสร้างตัวแบบไม่จำเป็นต้องยึดตามทฤษฎีมากนัก โดยส่วนใหญ่จะใช้เพื่อวัตถุประสงค์ในการพยากรณ์เป็นหลัก

ข้อเสียไม่สามารถอธิบายเหตุผลของการปรับตัวของตัวแปรต่าง ๆ ได้อย่างครอบคลุมรวมถึงไม่สามารถใช้ในการประเมินผลกระทบเชิงนโยบายซึ่งส่งผลต่อเศรษฐกิจในรอบด้าน