

บทที่ 2 ผลงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง

2.1 สรุปสาระสำคัญของเอกสารเกี่ยวข้อง

ศธาฤทธิ ลิขิตกกุล (2540) ศึกษาพฤติกรรมราคาและการพยากรณ์ราคาสินค้าเกษตรที่สำคัญ กรณีศึกษา: ข้าว ยางพารา มันสำปะหลัง ข้าวโพด กุ้งกุลาดำ โดยมีวัตถุประสงค์ในการศึกษา คือเพื่อวิเคราะห์ประสิทธิภาพของการการถ่ายทอดราคาของสินค้าเกษตรที่สำคัญ โดยวิเคราะห์และพยากรณ์การเคลื่อนไหวของราคาสินค้าด้วยแบบจำลอง ARIMA จากการศึกษาพบว่า การส่งผ่านราคาจากตลาดระดับส่งออกมายังตลาดระดับขายส่งกรุงเทพ ของสินค้าที่ศึกษาเกือบทุกประเภทมีประสิทธิภาพ ด้วยค่าความยืดหยุ่นของการส่งผ่านราคา อยู่ในช่วง 0.8658-0.9336 แต่สำหรับกรณีของมันสำปะหลังจะเป็นเพียง 0.3382 เท่านั้น สำหรับการส่งผ่านราคาจากตลาดขายส่งไปสู่เกษตรกรพบว่ายางพารา มันสำปะหลัง และกุ้งกุลาดำ มีประสิทธิภาพสูง ด้วยค่าความยืดหยุ่นของการส่งผ่านราคาอยู่ในช่วง 0.9487-0.9968 และสำหรับข้าวและข้าวโพดเป็นเพียง 0.453 และ 0.7568 ตามลำดับ

จากการศึกษาแบบจำลอง ARIMA ของราคาสินค้าข้างต้นพบว่าอนุกรมเวลาของทุกราคาสามารถปรับให้เป็นอนุกรมเวลาที่มีเสถียรภาพได้ ซึ่งสามารถนำไปใช้พยากรณ์ราคาในอนาคตได้ ราคาสินค้าทุกชนิด มีแนวโน้มที่สูงขึ้น นอกจากนี้ยังพบว่าราคาข้าวเปลือกที่เกษตรกรได้รับ และราคาข้าวโพดขายส่งตลาดกรุงเทพ มีลักษณะเคลื่อนไหวตามฤดูกาล ที่มีคาบเวลาแบบ 12 เดือนสำหรับราคาหัวมันสำปะหลัง ที่เกษตรกรได้รับ และราคามันอัดเม็ดขายส่งกรุงเทพ มีลักษณะการเคลื่อนไหวแบบวัฏจักร ซึ่งมีคาบเวลา 16 เดือน ส่วนราคากุ้งกุลาดำจะเคลื่อนไหวแบบฤดูกาลเพียง 5 เดือน

ปรารธนา ไชยสินโต (2541) ผลกระทบต่อปริมาณการส่งออกยางพาราไทยไปต่างประเทศ โดยมีการศึกษาเฉพาะปริมาณการส่งออกยางพาราของไทยไปตลาดต่างประเทศที่สำคัญ โดยเน้นการศึกษาถึงผลกระทบของราคาส่งออกยางแผ่นรมควันชั้น 3 (F.O.B) ของไทยไปตลาดโลก ราคายางแผ่นรมควันชั้น 3 ที่ตลาดสิงคโปร์ ราคาส่งออกยางแผ่นรมควันชั้น 3 (F.O.B) ของมาเลเซียไปตลาดโลกและราคายางแผ่นรมควันชั้น 3 ที่ตลาดโตเกียว ต่อการส่งออกยางพาราที่สำคัญของไทย ที่มีสัดส่วนตลาดเกินร้อยละ 5 โดยข้อมูลที่ใช้การศึกษาเป็นข้อมูลอนุกรมเวลาดังแต่

พ.ศ.2531 ถึง พ.ศ.2540 รวมระยะเวลา 10 ปี ผลการศึกษา โดยพิจารณาเฉพาะตลาดของประเทศสหรัฐอเมริกาได้แสดงให้เห็นว่า ปริมาณการส่งออกยางพาราไทยไปประเทศสหรัฐอเมริกาขึ้นกับราคาส่งออกยางพาราแผ่นรมควันชั้น 3 (F.O.B) ของไทยไปยังตลาดโลก ราคาส่งออกยางแผ่นรมควันชั้น 3 (F.O.B) ไปตลาดโลก ราคายางแผ่นรมควันชั้น 3 ที่สิงคโปร์ และราคา ยางแผ่นรมควันชั้น 3 ที่ตลาดโตเกียว โดยที่แบบจำลองนี้มีความเหมาะสมกับข้อมูล (R^2) เท่ากับ ร้อยละ 92.87 และปัจจัยที่มีผลต่อปริมาณการส่งออกยางพาราของไทยไปสหรัฐอเมริกาสามารถ อธิบายการเปลี่ยนแปลงได้อย่างมีนัยสำคัญทางสถิติที่ระดับความเชื่อมั่นร้อยละ 95

สุภาภรณ์ อัครไชยชาญ (2541) ศึกษาเรื่องยางพาราในเศรษฐกิจ ได้ทำการสำรวจ รวบรวมงานวิชาการที่ศึกษาเกี่ยวกับเรื่องยางพาราของไทยในตลาดโลกที่มีผลกระทบต่อเศรษฐกิจ ในส่วนของเรื่องการส่งออกยางพาราของประเทศไทย แบ่งออกเป็นสองตอน ตอนที่หนึ่งเกี่ยวกับ อุปสงค์ในการเสนอซื้อยางพาราของไทยในตลาดโลก ในส่วนที่สองเกี่ยวกับ แนวโน้มการส่งออก ยางพาราของไทย ซึ่งพิจารณาจากความต้องการของตลาดโลก การศึกษาพบว่า การประมาณสม การอุปสงค์ การเสนอซื้อของประเทศไทยแบ่งออกเป็น 2 ลักษณะ คือ สมการอุปสงค์การส่งออก ยางพาราไทยและอุปสงค์การนำเข้ายางพาราที่ประเทศต่าง ๆ ซึ่งจากไทย การสำรวจงานวิชาการ ที่ศึกษาเกี่ยวกับอุปสงค์ในการเสนอซื้อของยางพาราของไทยในตลาดโลกเท่าที่สามารถรวบรวมได้มี อยู่อย่างน้อย 12 เรื่อง โดยแบ่งเป็นงานวิชาการที่ประมาณการสมการการส่งออกยางพาราของไทย (Export Demand Function) จำนวน 9 เรื่อง งานที่ประมาณการสมการอุปสงค์การนำเข้า ยางพาราที่ประเทศต่าง ๆ ซึ่งจากไทยจำนวน 6 เรื่อง

Machado และ Margarido (2543) ศึกษาการส่งผ่านราคาของถั่วเหลืองที่มีคุณ ลักษณะเกี่ยวข้องกับฤดูกาล ในตลาดโลก (Seasonal price transmission in soybean international) โดยศึกษาและวิเคราะห์ถึงคุณลักษณะของสินค้าที่ขึ้นอยู่กับฤดูกาล เช่นถั่วเหลือง และความสัมพันธ์กับราคาที่ผันผวนเนื่องจากฤดูกาลในตลาดโลก โดยทำการเปรียบเทียบราคา ของถั่วเหลืองใน 3 ตลาด ได้แก่ ตลาดที่เมืองรอตเตอร์ดัม ตลาดที่เมืองชิคาโก และตลาดที่ ประเทศบราซิล และ อาเจนตินา เนื่องจากในตลาดแรกเป็นตลาดที่มีการนำเข้าถั่วเหลืองจาก ประเทศอเมริกาและกลุ่มทางอเมริกาใต้ได้แก่ ประเทศบราซิลและอาเจนตินา โดยใช้แบบจำลอง ทางเศรษฐมิติคือ ARIMA เป็นเครื่องมือในการวิเคราะห์ ผลการศึกษาโดยใช้ Arima พบว่า ราคาที่ ตลาดของกลุ่มประเทศในยุโรปจะมีความผันผวนน้อยกว่าในกลุ่มของอเมริกาและอเมริกาใต้เนื่อง

จาก ฤดูกาลของการปลูกถั่วเหลืองใน ภูมิภาคอเมริกาเหนือ ซึ่งจะเริ่มจาก เดือนกันยายน ไปจนถึง เดือนพฤษภาคมและในภูมิภาคอเมริกาใต้จะมีช่วงการปลูกที่แตกต่างกันโดยเริ่มจาก กุมภาพันธ์ ไปจนกระทั่งเดือนกันยายน ทำให้ในประเทศอเมริกา หรือ ประเทศในกลุ่มอเมริกาใต้จะมีราคาของ ถั่วเหลืองที่ขึ้นอยู่กับฤดูกาลแต่ในขณะเดียวกัน ประเทศในกลุ่มประชาคมยุโรปซึ่งเป็นประเทศนำ เข้ากับมีความผันผวนทางราคาที่น้อยกว่าใน 2 ภูมิภาคข้างต้นก็เนื่องจากประเทศในกลุ่มยุโรปมี การนำเข้าถั่วเหลืองจากทั้ง 2 ภูมิภาคข้างต้นเมื่อหมดฤดูกาลจากสหรัฐอเมริกา ก็จะเปลี่ยนมานำ เข้าจากทางอเมริกาใต้แทน ทำอุปทานมีอยู่ในปริมาณที่ค่อนข้างคงที่ เลยเป็นผลให้ราคาในกลุ่ม ของทางสหภาพยุโรปมีค่าความผันผวนน้อยกว่าใน อเมริกาเหนือและอเมริกาใต้

มัทยรัตน์ ภาสน์พิพัฒน์กุล (2544) การศึกษาความสัมพันธ์ระหว่างราคาขายพารา แผนรมควันตลาดส่งมอบทันทีในประเทศไทยกับราคาขายพาราในตลาดส่งมอบล่วงหน้า โดยการ ศึกษาพฤติกรรมของขายพาราแผ่นรมควัน ใช้วิธี Vector Autoregressive Model (VAR) และ Vector Error Correction Model (VEC) และศึกษาประสิทธิภาพของตลาดโดยวิธี Cointegration และ Error Correction Mechanism (ECM) โดยใช้ข้อมูลราคาขายพาราแผ่นรมควันชั้น 1 (RSS1) และราคาขายแผ่นรมควันชั้น 3 (RSS3) ในตลาดที่สำคัญ 3 ตลาดในประเทศไทย ได้แก่ ราคา ณ ตลาดกลางหาดใหญ่ ราคาส่งออก (F.O.B) ที่ท่าเรือกรุงเทพฯ และราคาส่งออก (F.O.B) ณ ท่า สงขลา เป็นตัวแทนราคาในตลาดส่งมอบทันที ตัวแปรราคาในตลาดล่วงหน้าที่ใช้ คือ ราคาขาย แผ่นรมควันชั้น 1 และ ชั้น 3 ที่ตลาดลอนดอน กัวลาลัมเปอร์ นิวยอร์ก สิงคโปร์ ตลาดโกเบ และ ตลาดโตเกียว พบว่าราคาในตลาดล่วงหน้าขายพาราในต่างประเทศที่สามารถนำมาอธิบายราคา ตลาดส่งมอบทันทีในอนาคตได้อย่างมีประสิทธิภาพสำหรับตลาดหาดใหญ่ คือ ตลาดสิงคโปร์เป็น หลัก สำหรับราคาขายพาราแผ่นรมควันชั้น 1 และชั้น 3 และราคาส่งออก ณ ท่าเรือกรุงเทพฯ ใช้ ตลาดกัวลาลัมเปอร์ สิงคโปร์ ลอนดอน ในการอธิบายราคาขายพาราชั้น 3 ส่วนราคาส่งออก ณ ท่า เรือสงขลา สามารถใช้ราคาตลาดกัวลาลัมเปอร์ ลอนดอน สิงคโปร์ สำหรับอธิบายราคาขายชั้น 1 และ 3

คัตนา กันตะพัฒนะ (2546) การวิเคราะห์ราคาขายพาราไทยในตลาดสหรัฐอเมริกา และตลาดสิงคโปร์ เพื่อศึกษาถึงการกำหนดราคาขายพาราโดยอาศัยคุณภาพในตลาดสหรัฐ อเมริกา และสิงคโปร์ว่ามีความแตกต่างกันอย่างไร ผลลัพธ์ที่นำมาใช้ในการศึกษาครั้งนี้ คือ ขายพาราแผ่นรมควันซึ่งเป็นผลิตภัณฑ์ที่ทำกำไรส่งออกมากที่สุด วิธีที่ใช้ในการศึกษาครั้งนี้คือ

วิธีการวิเคราะห์ราคาโดยอาศัยคุณภาพ และการทดสอบ Unit root เพื่อวิเคราะห์ความนิ่งของข้อมูล โดยลักษณะข้อมูลที่ใช้ในการศึกษาเป็นข้อมูลรายสัปดาห์ตั้งแต่เดือน มกราคม พ.ศ.2541 ถึงเดือน ธันวาคม พ.ศ.2545 ผลการศึกษาพบว่าข้อมูลราคายางพาราของประเทศไทยในตลาดสหรัฐอเมริกา และตลาดสิงคโปร์ มีลักษณะนิ่ง หรือไม่มี Unit root นอกจากนี้ผลการศึกษายังพบว่า คุณภาพของยางพาราซึ่งในที่นี้แทนด้วยความชื้น มีผลกระทบต่อระดับราคายางพาราอย่างมีนัยสำคัญทางสถิติ ซึ่งเป็นไปตามสมมติฐานที่ตั้งไว้ คือเมื่อความชื้นของยางพาราเพิ่มขึ้น (ลดลง) ราคายางพาราจะลดลง (เพิ่มขึ้น) และยังพบว่า การเปลี่ยนแปลงของคุณภาพยางพารานั้นจะส่งผลกระทบต่อราคายางในตลาดสหรัฐอเมริกา มากกว่าในตลาดสิงคโปร์ ทั้งนี้เนื่องจากจุดประสงค์ของตลาดสิงคโปร์เป็นการซื้อขายเพื่อเก็งกำไร ดังนั้นจึงทำให้คุณภาพเป็นสิ่งสำคัญในการกำหนดราคาในตลาดสหรัฐอเมริกา มากกว่าในตลาดสิงคโปร์

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved