

บทที่ 1

บทนำ

1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา

นับตั้งแต่ประเทศไทยมีการติดต่อกับต่างประเทศเป็นต้นมา การค้าระหว่างประเทศก็กลายเป็นปัจจัยหลักที่สำคัญปัจจัยหนึ่งซึ่งช่วยในการพัฒนาเศรษฐกิจเพิ่มพูนรายได้ของประเทศ และการที่ต้องติดต่อกับต่างประเทศต่าง ๆ นี้เอง โดยเฉพาะการส่งออกสินค้าไปยังต่างประเทศเพื่อสร้างรายได้ พบว่าประเทศไทยมีสินค้าที่ทำการส่งออกมากที่สุด 6 อันดับแรกคือ เครื่องคอมพิวเตอร์ อุปกรณ์และส่วนประกอบ เสื้อผ้าสำเร็จรูป แผงวงจรไฟฟ้า ข้าว อาหารทะเลกระป๋องและแปรรูป อัญมณีและเครื่องประดับ ที่มีสัดส่วนการส่งออกมากที่สุด (ตารางที่ 1.1)

เป็นที่ทราบกันว่าประเทศไทยเป็นประเทศที่ต้องพึ่งพาการเกษตรมาอย่างยาวนาน ด้วยสภาพแวดล้อมภูมิประเทศ และความชำนาญอันได้รับการถ่ายทอดมาจากบรรพบุรุษ ด้วยเหตุนี้จึงทำให้สินค้าเกษตรเป็นสินค้าประเภทหนึ่งที่มีการส่งออกทุกๆปีด้วยมูลค่าที่ค่อนข้างสูง ซึ่งหากพิจารณาข้อมูลพบว่าสินค้าของประเทศไทยที่มีการส่งออก 10 อันดับในปี 2538-2541 มีการส่งออกสินค้าเกษตรสามชนิดเป็นสินค้าหลักได้แก่ ข้าว กุ้งแช่แข็ง และยางพารา (ตารางที่ 1.1) โดยมีมูลค่าการส่งออกข้าว เป็นอันดับที่ 4 กุ้งแช่แข็ง เป็นอันดับที่ 8 และยางพารา เป็นอันดับที่ 9 โดยเป็นมูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรที่ติดอันดับการส่งออกของไทยที่สูงที่สุด

ตารางที่ 1.1 สัดส่วนการส่งออกคิดเป็นร้อยละของปริมาณการส่งออกทั้งหมดของประเทศไทย
ระหว่างปี 2538 - 2541

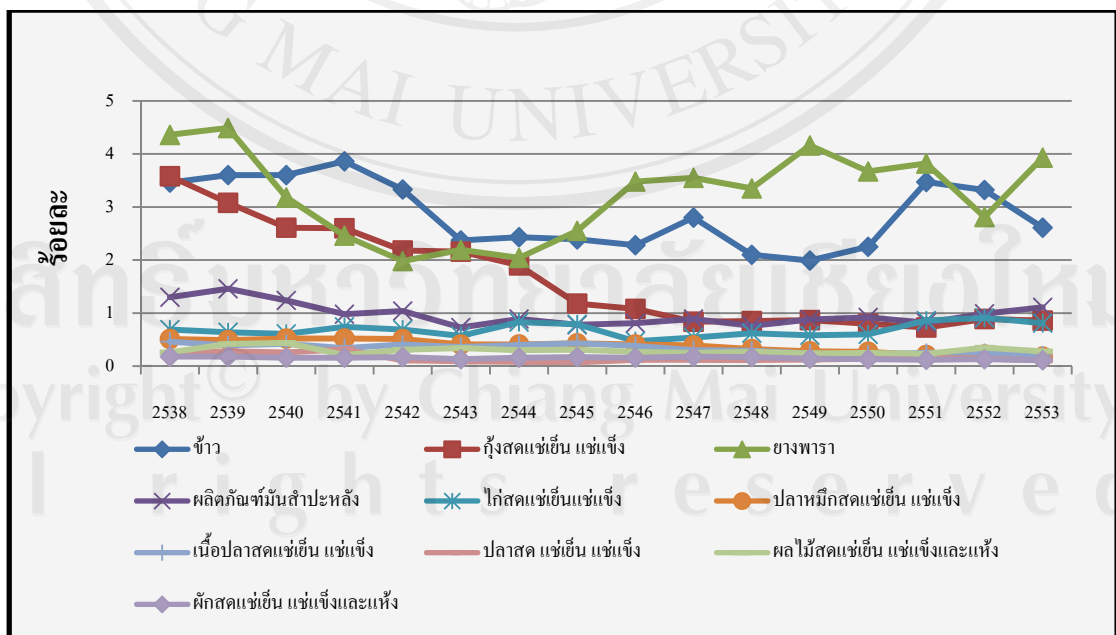
| ลำดับที่ | ชื่อสินค้า | สัดส่วน (%) รายปี | | | |
|----------|---|-------------------|-------|-------|-------|
| | | 2538 | 2539 | 2540 | 2541 |
| 1 | เครื่องคอมพิวเตอร์ อุปกรณ์และส่วนประกอบ | 9.39 | 12.01 | 12.31 | 14.34 |
| 2 | เสื้อผ้าสำเร็จรูป | 7.25 | 5.66 | 5.37 | 5.47 |
| 3 | แผงวงจรไฟฟ้า | 4.14 | 4.15 | 4.20 | 4.17 |
| 4 | ข้าว | 3.46 | 3.60 | 3.60 | 3.86 |
| 5 | อาหารทะเลกระป๋องและแปรรูป | 2.82 | 2.89 | 3.23 | 3.44 |
| 6 | อัญมณีและเครื่องประดับ | 3.87 | 3.96 | 4.05 | 3.42 |
| 7 | เครื่องรับวิทยุโทรทัศน์และส่วนประกอบ | 2.34 | 2.54 | 2.48 | 2.66 |

ตารางที่ 1.1(ต่อ)

| ลำดับที่ | ชื่อสินค้า | สัดส่วน (%) รายปี | | | |
|----------|-----------------------------|-------------------|-------|-------|-------|
| | | 2538 | 2539 | 2540 | 2541 |
| 8 | กุ้งสดแช่เย็น แช่แข็ง | 3.58 | 3.08 | 2.61 | 2.60 |
| 9 | ยางพารา | 4.36 | 4.49 | 3.18 | 2.46 |
| 10 | รถยนต์ อุปกรณ์และส่วนประกอบ | 1.16 | 1.16 | 1.86 | 2.24 |
| | รวม 10 รายการ | 42.35 | 43.53 | 42.88 | 44.67 |
| | อื่นๆ | 57.65 | 56.47 | 57.12 | 55.33 |
| | รวมทั้งสิ้น | 100.0 | 100.0 | 100.0 | 100.0 |

ที่มา : ศูนย์เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร สำนักงานปลัดกระทรวงพาณิชย์และกรมศุลกากรปี 2553

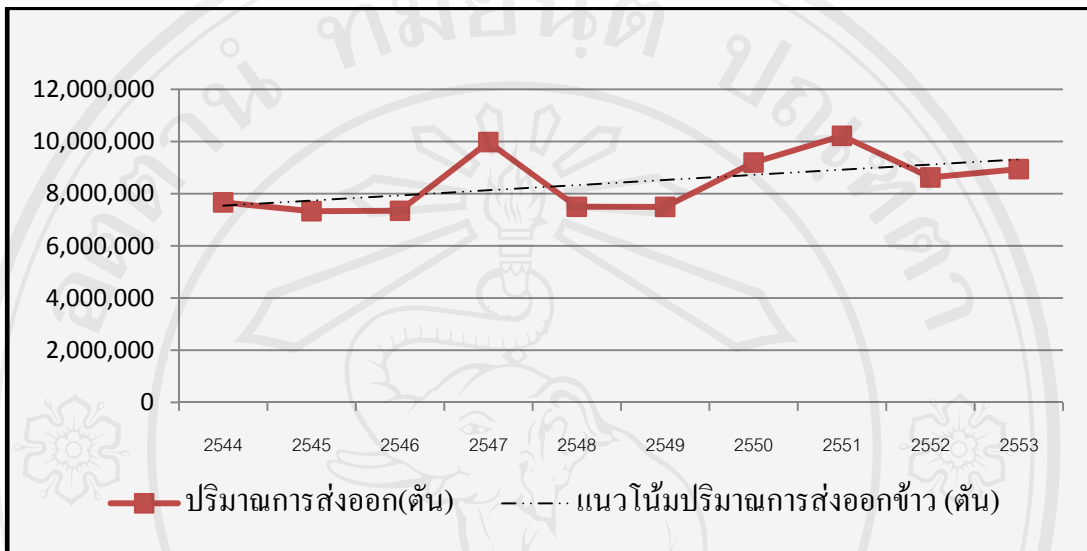
เมื่อพิจารณาสัดส่วนในหมวดของการส่งออกสินค้าเกษตรทั้ง 3 ชนิด พบว่าการส่งออกสินค้าเกษตรทั้งสามชนิดได้แก่ ข้าว กุ้งแช่แข็ง ยางพาราจะคิดเป็นสัดส่วนร้อยละ 8.92 ของมูลค่าการส่งออกสินค้าทั้งหมดของประเทศไทย แต่หากเทียบกับมูลค่าของสินค้าเกษตรที่ส่งออกใน 10 อันดับ พบว่ามีสัดส่วนการส่งออกสูงถึงร้อยละ 73.17 ของสินค้าเกษตรและในปีถัดไป 2542-2553 พบว่าทั้งมูลค่าการส่งออกรวมและสัดส่วนของสินค้าเกษตรที่ส่งออกนั้นมีการเปลี่ยนแปลงอยู่เสมอ



ที่มา : ศูนย์เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร สำนักงานปลัดกระทรวงพาณิชย์และกรมศุลกากร

รูปภาพที่ 1.1 สัดส่วนมูลค่าสินค้าเกษตร 10 อันดับแรก ระหว่างปี 2538 - 2553

ปริมาณการส่งออกข้าวของประเทศไทยที่ส่งออกไปยังต่างประเทศมีแนวโน้มเพิ่มสูงขึ้น โดยเฉลี่ย ตั้งแต่ปี 2544 ถึงปี 2553 จากปริมาณส่งออก 7,664,958 ตันในปี 2544 เป็น 8,939,630 ตัน ในปี 2553 คิดเป็นอัตราการส่งออกเพิ่มขึ้นร้อยละ 16.63



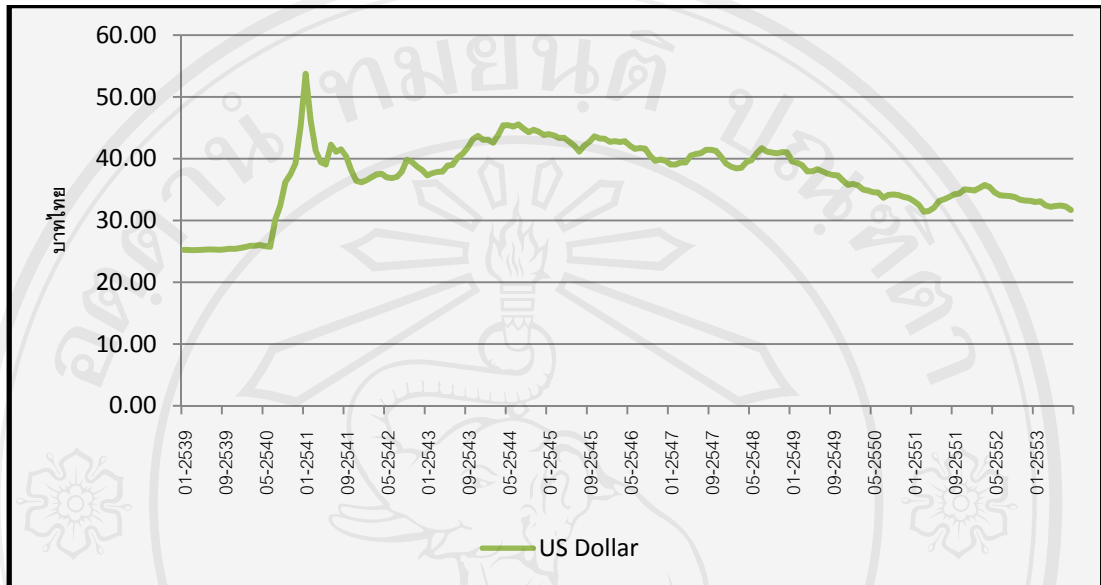
ที่มา : ศูนย์เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร สำนักงานปลัดกระทรวงพาณิชย์และกรมศุลกากร

รูปภาพที่ 1.2 การเปลี่ยนแปลงของปริมาณการส่งออกข้าวของประเทศไทยระหว่างปี 2539 ถึงปี 2553

อย่างไรก็ตามการส่งออกสินค้าไปต่างประเทศไม่ได้ขึ้นอยู่กับผู้ผลิตเพียงฝ่ายเดียว หากสามารถเกิดขึ้นได้จากปัจจัยหลายด้าน โดยเฉพาะปัญหาจากภาวะเศรษฐกิจ เช่น วิกฤติเศรษฐกิจปี 2540 อันเกิดจากเสถียรภาพและวินัยทางการเงินภายในประเทศ ที่เรียกกันว่า “วิกฤติต้มยำกุ้ง” เนื่องจากจุดเริ่มต้นของวิกฤติเศรษฐกิจเริ่มต้นที่ประเทศไทย หรือไม่ว่าจะเป็นปัญหาจากสถาบันการเงินซึ่งเพิ่งเกิดขึ้นไม่นานมานี้ อันเกิดจากความหละหลวมของการให้สินเชื่อแก่ลูกหนี้ชั้นเลว (Sub-prime) ที่เรียกกันว่า “วิกฤติแฮมเบอร์เกอร์” เนื่องจากจุดเริ่มต้นของวิกฤติเศรษฐกิจเริ่มต้นที่ประเทศสหรัฐอเมริกา โดยแต่ละวิกฤติเศรษฐกิจนั้นมีลักษณะที่คล้ายคลึงกันกล่าวคือมีลักษณะของผลกระทบที่ลุกลามไปยังประเทศต่างๆอย่างรวดเร็วหรือที่เรียกว่า Domino Effect ด้วยลักษณะดังกล่าวนี้ทำให้วิกฤติการณ์ดังกล่าวมีระยะเวลายาวนานและส่งผลกระทบต่อหลายประเทศที่มีการติดต่อกับค้าขายรวมไปถึงประเทศไทยด้วย

ปัญหาหรือวิกฤติการณ์ดังกล่าวนี้ทำให้ประเทศต่างๆมีการปรับปรุงระบบและดำเนินนโยบายทางเศรษฐกิจของแต่ละประเทศให้เหมาะสมสามารถเผชิญกับปัญหาดังกล่าวได้ ซึ่งสำหรับในประเทศไทยแล้วในช่วงวิกฤติเศรษฐกิจปี 2540 ได้มีการเปลี่ยนแปลงที่สำคัญคือการเปลี่ยนระบบ

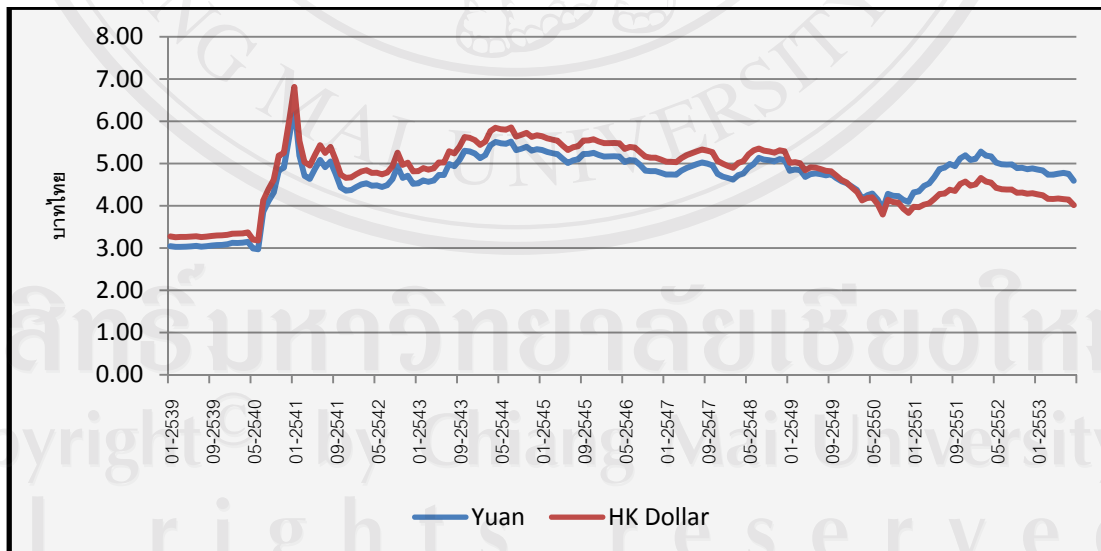
อัตราแลกเปลี่ยนจาก ระบบตะกร้าเงิน (basket of currencies) มาเป็นระบบอัตราแลกเปลี่ยนลอยตัวแบบมีการจัดการ (manage float)



ที่มา : ธนาคารแห่งประเทศไทย ปี 2553

หมายเหตุ : อัตราแลกเปลี่ยนค่าเงินบาทไทยต่อหนึ่งสกุลเงินต่างประเทศ

รูปภาพที่ 1.3 การเคลื่อนไหวของอัตราแลกเปลี่ยนค่าเงินบาทไทยต่อดอลลาร์สหรัฐระหว่างปี 2539 ถึงปี 2553



ที่มา : ธนาคารแห่งประเทศไทย ปี 2553

หมายเหตุ : อัตราแลกเปลี่ยนค่าเงินบาทไทยต่อหนึ่งสกุลเงินต่างประเทศ

รูปภาพที่ 1.4 การเคลื่อนไหวของอัตราแลกเปลี่ยนค่าเงินบาทไทยต่อหยวนจีนและดอลลาร์ฮ่องกงระหว่างปี 2539 ถึงปี 2553

ทั้งนี้สังเกตได้ว่าข้อดีของการเปลี่ยนระบบอัตราแลกเปลี่ยนจาก ระบบตะกร้าเงิน มาเป็น ระบบอัตราแลกเปลี่ยนลอยตัวแบบมีการจัดการ การเปลี่ยนระบบอัตราแลกเปลี่ยนจาก ระบบ ตะกร้าเงิน มาเป็นระบบอัตราแลกเปลี่ยนลอยตัวแบบมีการจัดการ ดังรูปภาพที่ 1.3 และ 1.4 แสดง ให้เห็นถึงการเคลื่อนไหวของอัตราแลกเปลี่ยนค่าเงินบาทไทยต่อค่าเงินต่างประเทศที่เป็นคู่ค้าสินค้า ข้าวหอมมะลิที่สำคัญของไทย 3 อันดับแรก ได้แก่ ประเทศสหรัฐอเมริกา ประเทศจีนและประเทศ ฮ่องกง ที่ประเทศไทยมีส่วนการส่งออกข้าวหอมมะลิมากที่สุด (ตารางที่ 1.2)

ตารางที่ 1.2 มูลค่าและสัดส่วนการส่งออกข้าวหอมมะลิ ชั้น 2 ของประเทศไทย

| ลำดับที่ | ประเทศ | 2550 | 2551 | 2552 | 2553 |
|----------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | | Market share | Market share | Market share | Market share |
| 1 | สหรัฐอเมริกา | 21.10 | 23.25 | 22.59 | 24.69 |
| 2 | จีน | 12.98 | 8.49 | 9.54* | 8.32* |
| 3 | ฮ่องกง | 8.10 | 8.17 | 7.90** | 7.55** |

ที่มา : ศูนย์เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร สำนักงานปลัดกระทรวงพาณิชย์ โดยความร่วมมือจากกรม ศุลกากร ปี 2553

หมายเหตุ: * อันดับที่สองเปลี่ยนเป็นฮ่องกง ** อันดับสามเปลี่ยนเป็นสิงคโปร์

ด้วยเหตุนี้การเปลี่ยนแปลงดังกล่าวได้แสดงให้เห็นถึงสภาวะที่แท้จริงในตลาดอัตรา แลกเปลี่ยนระหว่างประเทศ แต่ข้อเสีย คือ ความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนถือได้ว่าเป็นต้นทุนต่อ การส่งออกสินค้ากล่าวคือ หากอัตราแลกเปลี่ยนมีค่าสูงขึ้นย่อมเท่ากับราคาสินค้าที่ทำการส่งออก นั้นแพงขึ้น ตรงกันข้ามหากอัตราแลกเปลี่ยนมีค่าลดลงจะเปรียบเสมือนสินค้าที่มีการส่งออกมีราคา ถูกลงด้วย จึงกล่าวได้อีกนัยหนึ่งว่าอัตราแลกเปลี่ยนที่ลอยตัวได้สะท้อนให้เห็นถึงดุลการชำระเงินที่ แท้จริงได้ในระดับหนึ่ง ทำให้เห็นสภาวะของค่าเงินสกุลต่างๆในตลาดอัตราแลกเปลี่ยนเงินตรา ระหว่างประเทศแต่ในทางกลับกันก็ทำให้เกิดต้นทุนแก่ผู้ทำการส่งออกในกรณีที่การเปลี่ยนแปลง ของต้นทุนดังกล่าวนี้เป็นไปอย่างรวดเร็วหรือมีความผันผวนนั่นเอง ดังนั้นความผันผวนของอัตรา แลกเปลี่ยนจึงเป็นสิ่งที่น่าสนใจในการที่จะทำการทดสอบ

ดังนั้นวิกฤตการณ์ต่างๆที่เกิดขึ้นภายในประเทศหรือต่างประเทศก็ตามย่อมส่งผลต่ออุปสงค์และอุปทานความต้องการสินค้าข้าวของประเทศไทย เมื่อพิจารณาจากการส่งออกข้าวและ ประเทศผู้นำเข้าข้าวเป็นหลักของประเทศไทยแล้ว จึงมีความสนใจในสภาวะของอัตราแลกเปลี่ยน และสถานการณ์ของสินค้าข้าวหอมมะลิของไทยในต่างประเทศ โดยให้ความสำคัญเกี่ยวกับสภาวะ

ของระดับความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยน โดยทำการประมาณค่าด้วยวิธี GARCH นับตั้งแต่ปี 2540 ที่ประเทศไทยมีการเปลี่ยนแปลงระบบอัตราแลกเปลี่ยนเป็นระบบลอยตัวโดยจะศึกษาความสัมพันธ์ของความผันผวนดังกล่าวว่าก่อให้เกิดผลกระทบอย่างไรบ้างต่อปริมาณการส่งออกข้าวของประเทศไทยที่ทำการส่งออกไปยังต่างประเทศ

1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา

การศึกษานี้มีวัตถุประสงค์หลักเพื่อหาความสัมพันธ์ของความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศที่เป็นคู่ค้าสำคัญในการส่งออกข้าวของประเทศไทย ตลอดจนอธิบายลักษณะการค้าข้าวของไทยและสถานการณ์ข้าวของไทยที่ส่งออกไปยังประเทศอเมริกา ประเทศจีนและประเทศฮ่องกง โดยมีวัตถุประสงค์ย่อยดังนี้

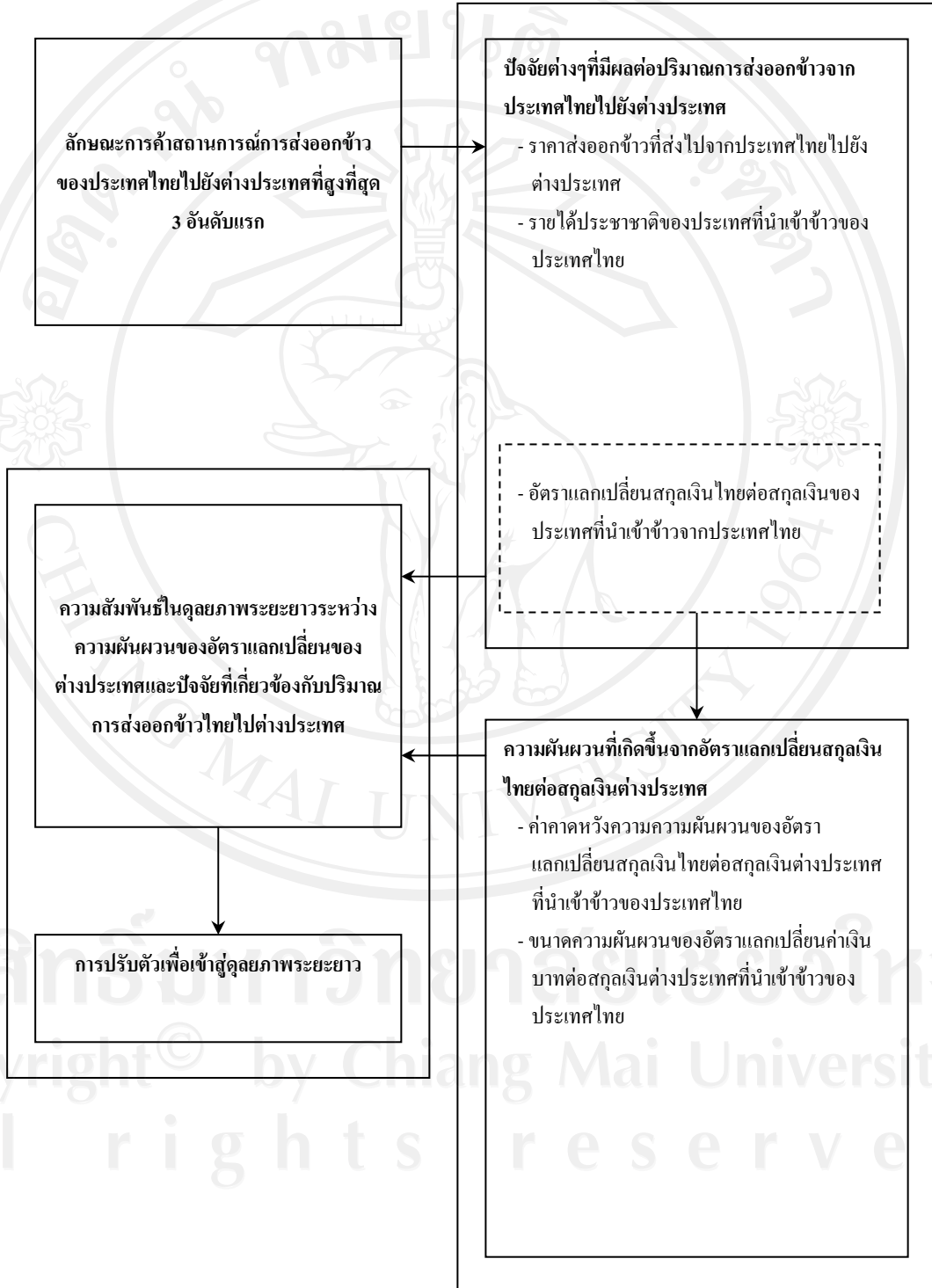
1. เพื่อทราบลักษณะการค้าและสถานการณ์ส่งออกข้าวของประเทศไทยกับประเทศผู้นำเข้าข้าวของไทย
2. เพื่อทราบความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศผู้นำเข้าข้าวของไทยซึ่งได้แก่ประเทศสหรัฐอเมริกา ประเทศจีนและประเทศฮ่องกง โดยใช้ข้าวหอมมะลิเป็นตัวแทนของข้อมูลที่จะทำการศึกษา
3. เพื่อทราบความสัมพันธ์ในดุลยภาพระยะยาวของความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศอเมริกา ประเทศจีนและประเทศฮ่องกง กับราคา และปัจจัยต่างๆในการส่งออกข้าว โดยใช้ข้าวหอมมะลิเป็นตัวแทนของข้อมูลที่จะทำการศึกษา

1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ

สามารถเข้าใจถึงสถานการณ์การส่งออกข้าวของประเทศไทย ตลอดจนแสดงทิศทางความสัมพันธ์ของความผันผวนและปัจจัยอื่นๆ กับปริมาณข้าวที่ทำการส่งออกไปยังประเทศต่างๆ อันเป็นประโยชน์ในการติดตามข่าวสารทางการตลาดของผู้ที่เกี่ยวข้องและวางแผนการผลิตได้อย่างถูกต้อง

1.4. กรอบแนวคิดและวิธีการศึกษา

1.4.1 การออกแบบวิจัย



1.4.2 ขอบเขต

การศึกษาครั้งนี้ ใช้ข้อมูลทุติยภูมิ (secondary data) ลักษณะเชิงอนุกรมเวลา (time series data) โดยใช้ข้อมูลรายไตรมาสของข้าวที่มีมูลค่าการส่งออกมากที่สุด ได้แก่ ข้าวหอมมะลิ 100 เปอร์เซ็น ชั้นสอง ตั้งแต่ไตรมาสที่ 1 ปี 2544 ถึงไตรมาสที่ 2 ปี 2553 ในขณะที่อัตราแลกเปลี่ยนของประเทศคู่ค้าที่นำเข้าสินค้าเกษตรจากประเทศไทยสูงสุด ได้แก่ ประเทศสหรัฐอเมริกา (ดอลลาร์สหรัฐ) ประเทศจีน (หยวน) และประเทศฮ่องกง (ดอลลาร์ฮ่องกง) โดยใช้ข้อมูลระหว่างเดือน มกราคม พ.ศ. 2544 ถึงเดือนตุลาคม พ.ศ. 2553

1.4.3 วิธีการวิจัย

ในการศึกษาครั้งนี้ได้ศึกษาถึงสถานการณ์การค้าข้าวในปัจจุบันเพื่อตอบวัตถุประสงค์ข้อแรก จากนั้นได้ศึกษาถึงความสัมพันธ์ของการผันผวนของสกุลเงินของประเทศคู่ค้าที่เป็นหลักว่ามีอิทธิพลต่อปริมาณการส่งออกข้าวซึ่งใช้ข้าวหอมมะลิชั้นสองที่มีมูลค่าการส่งออกสูงสุดเป็นตัวแทนข้อมูลข้าวของประเทศไทยที่นำมาศึกษา ทั้งนี้งานวิจัยได้ใช้ข้อมูลรายไตรมาสตั้งแต่เดือน มกราคม พ.ศ.2544 ถึงเดือนตุลาคม พ.ศ.2553 โดยหาค่าความผันผวนและพยากรณ์ค่าความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยน โดยใช้แบบจำลอง GARCH เป็นการตอบวัตถุประสงค์ข้อที่สอง

ในการตอบวัตถุประสงค์ข้อที่สามได้จากการทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาวระหว่างความผันผวนของสกุลเงินของประเทศคู่ค้าว่ามีอิทธิพลต่อระดับราคาสินค้าส่งออกหรือไม่ โดยอาศัยวิธีการทดสอบการร่วมไปด้วยกัน (Co-integration) ของ Johansen and Juselius แล้วจึงใช้ Impulse Response Function และ Variance Decomposition เพื่ออธิบายการปรับตัวในระยะสั้นให้เข้าสู่ดุลยภาพในระยะยาว

1.5 แหล่งข้อมูลวิจัย

ในการศึกษาครั้งนี้ทำการศึกษาเกี่ยวกับการส่งออกข้าวของประเทศไทยโดยใช้ข้าวหอมมะลิ 100% ชั้นสอง ทั้งนี้จะทำการศึกษาความสัมพันธ์ของความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยน ราคาข้าว ผลิตภัณฑ์มวลรวม (GDP) ของประเทศคู่ค้า และปริมาณที่ส่งออกไปยังประเทศคู่ค้าที่สำคัญอันได้แก่ ประเทศสหรัฐอเมริกา ประเทศจีนและประเทศฮ่องกง

โดยนำข้อมูลมาจาก International Financial Statistics (IFS-CD-ROM) จัดทำโดย International Monetary Fund (IMF) และฐานข้อมูล Reuter 2007 จากห้องสมุดคณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ Finance Investment Center (FIC) ศูนย์ข้อมูลการลงทุนทางการเงิน มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ กระทรวงพาณิชย์ และกรมศุลกากร

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved