

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	จ
สารบัญตาราง	ฉ
สารบัญภาพ	ฌ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 หลักการและเหตุผล	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	4
1.3 ประโยชน์ที่จะได้รับจากการศึกษา	4
1.4 แผนการดำเนินงาน ขอบเขต	5
บทที่ 2 กรอบแนวคิดทางทฤษฎี และงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	
2.1 แนวคิดความเชื่อมโยงตลาด	6
2.2 แนวคิด Cointegration	7
2.2.1 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล	7
2.2.2 การทดสอบ Cointegration	10
2.3 สรุปสาระสำคัญจากเอกสารที่เกี่ยวข้อง	15
บทที่ 3 ระเบียบวิธีการศึกษา	
3.1 การศึกษาสถานการณ์ราคาสินค้าเกษตรในตลาดต่างๆ	20
3.2 การศึกษาลักษณะการกำหนดราคา	20
3.2.1 แบบจำลองการกำหนดราคา	20
3.2.2 วิธีการวิเคราะห์	21
3.3 การหาค่าดัชนีความเชื่อมโยงตลาด	23
3.4 การทดสอบประสิทธิภาพการกำหนดราคา	23
3.5 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	23
3.6 คำจำกัดความ	24

บทที่ 4 ลักษณะการผลิตและการตลาด

4.1	ลักษณะการผลิตและการตลาดยางพารา	25
4.1.1	ลักษณะการผลิต	25
4.1.2	ลักษณะการตลาด	26
4.1.3	การแบ่งระบบตลาดยางพารา	32
4.2	ลักษณะการผลิตและการตลาดมันสำปะหลัง	33
4.2.1	ลักษณะการผลิต	33
4.2.2	ลักษณะการตลาด	35
4.2.3	การแบ่งระบบตลาดมันสำปะหลัง	37
4.3	ลักษณะการผลิตและการตลาดข้าวโพด	39
4.3.1	ลักษณะการผลิต	39
4.3.2	ลักษณะการตลาด	44
4.3.3	การแบ่งระบบตลาดข้าวโพด	46

บทที่ 5 ผลการศึกษา

5.1	สถานการณ์ราคายางพาราที่ตลาดระดับต่างๆ	48
5.1.1	ราคายางพาราที่ตลาดท้องถิ่นสงขลา(PFR) ในช่วงปี 2537-2542	49
5.1.2	ราคายางพาราที่ตลาดกลางหาดใหญ่ (PHR) ในช่วงปี 2537-2542	50
5.1.3	ราคายางพาราที่ตลาดท่าเรือส่งออก (PER) ในช่วงปี 2537-2542	51
5.1.4	ราคายางพาราที่ตลาดประเทศสิงคโปร์ (PSR) ในช่วงปี 2537-2542	52
5.1.5	ราคายางพาราที่ตลาดประเทศมาเลเซีย (PMR) ในช่วงปี 2537-2542	53
5.2	ผลการศึกษาลักษณะการกำหนดราคายางพารา	
5.2.1	ผลการทดสอบ Unit Root ข้อมูลราคายางพารา	55
5.2.2	ผลการทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาว (Cointegration) ของระดับราคายางพารา	58
5.2.3	ผลการทดสอบประสิทธิภาพการกำหนดราคายางพารา	63
5.2.4	ผลการทดสอบการปรับตัวเข้าสู่ดุลยภาพในระยะสั้น (Error Correction Mechanism : ECM)ของราคายางพารา	65
5.2.5	ผลการคำนวณหาดัชนีความเชื่อมโยงตลาด (Index of Market Connection : IMC)ของตลาดยางพารา	67

5.3	สรุปการกำหนดราคาระหว่างตลาดยางพารา	68
5.4	สถานการณ์ราคามันสำปะหลังที่ตลาดระดับต่างๆ	70
5.4.1	ราคามันสำปะหลังที่ตลาดท้องถิ่น(PFC) ในช่วงปี 2537-2542	70
5.4.2	ราคามันสำปะหลังที่ตลาดกลางขายส่งกรุงเทพฯ (PBC) ในช่วงปี 2537-2542	71
5.4.3	ราคามันสำปะหลังที่ตลาดท่าเรือส่งออก (PEC) ในช่วงปี 2537-2542	72
5.4.4	ราคามันสำปะหลังที่ตลาดสหภาพยุโรป (PEuC) ในช่วงปี 2537-2542	73
5.5	ผลการศึกษาลักษณะการกำหนดราคามันสำปะหลัง	74
5.5.1	ผลการทดสอบ Unit Root ข้อมูลราคามันสำปะหลัง	74
5.5.3	ผลการทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาว (Cointegration) ของระดับราคามันสำปะหลัง	77
5.5.4	ผลการทดสอบประสิทธิภาพการกำหนดราคามันสำปะหลัง	81
5.5.5	ผลการทดสอบการปรับตัวเข้าสู่ดุลยภาพในระยะสั้น (Error Correction Mechanism : ECM)ของราคามันสำปะหลัง	82
5.5.6	ผลการคำนวณหาดัชนีความเชื่อมโยงตลาด (Index of Market Connection : IMC)ของตลาดมันสำปะหลัง	84
5.6	สรุปการกำหนดราคาระหว่างตลาดมันสำปะหลัง	85
5.7	สถานการณ์ราคาข้าวโพดที่ตลาดระดับต่างๆ	86
5.7.1	ราคาข้าวโพดที่ตลาดท้องถิ่น(PFM) ในช่วงปี 2537-2542	87
5.7.2	ราคาข้าวโพดที่ตลาดกลางขายส่งกรุงเทพฯ (PBM) ในช่วงปี 2537-2542	87
5.7.3	ราคาข้าวโพดที่ตลาดท่าเรือส่งออก (PEM) ในช่วงปี 2537-2542	88
5.7.4	ราคาข้าวโพดที่ตลาดชิคาโก (PCM) ในช่วงปี 2537-2542	89
5.8	ผลการศึกษาลักษณะการกำหนดราคาข้าวโพด	91
5.8.1	ผลการทดสอบ Unit Root ข้อมูลราคาข้าวโพด	91
5.8.2	ผลการทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาว (Cointegration) ของระดับราคาข้าวโพด	94
5.8.3	ผลการทดสอบประสิทธิภาพการกำหนดราคาข้าวโพด	97
5.8.4	ผลการทดสอบการปรับตัวเข้าสู่ดุลยภาพในระยะสั้น (Error Correction Mechanism : ECM)ของราคาข้าวโพด	98

5.8.5 ผลการคำนวณหาดัชนีความเชื่อมโยงตลาด (Index of Market Connection : IMC)ของตลาดข้าวโพด	100
5.9 สรุปการกำหนดราคาระหว่างตลาดข้าวโพด	101
บทที่ 6 สรุปและข้อเสนอแนะ	
6.1 สรุปผลการศึกษาดตลาดยางพารา	103
6.2 สรุปผลการศึกษาดตลาดมันสำปะหลัง	104
6.3 สรุปผลการศึกษาข้าวโพด	105
6.4 ข้อเสนอแนะจากผลการศึกษา	105
6.5 ข้อเสนอแนะเพื่อการศึกษาครั้งต่อไป	107
เอกสารอ้างอิง	108
ภาคผนวก	
ภาคผนวก ก ข้อมูลราคายางพารา มันสำปะหลัง และข้าวโพด	112
ภาคผนวก ข ผลการวิเคราะห์การกำหนดราคา	121
ประวัติผู้เขียน	125

สารบัญตาราง

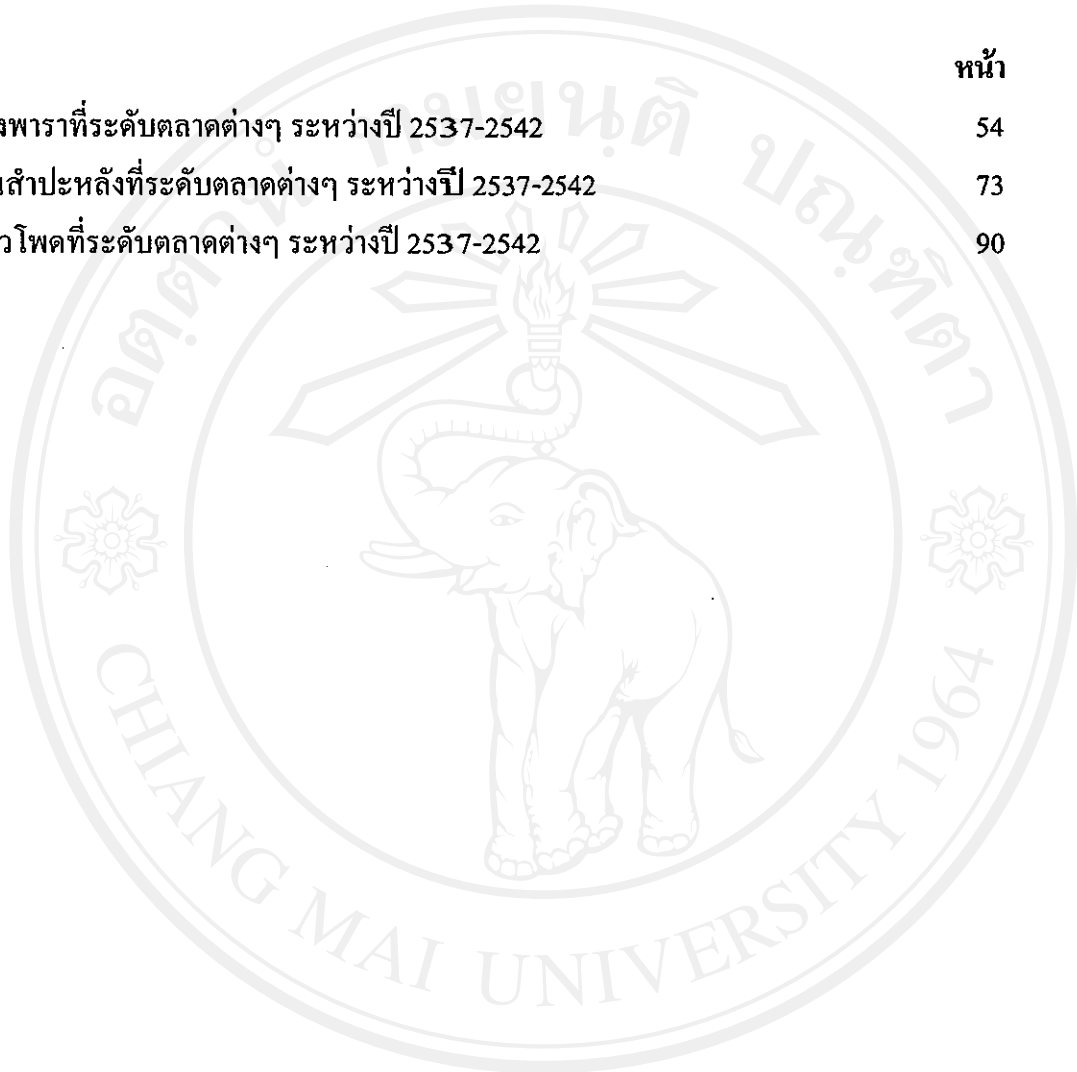
ตาราง	หน้า
1.1 มูลค่าสินค้าเกษตรส่งออก นำเข้าและดุลการค้าของประเทศไทย ปี 2540 - 2544	1
1.2 ปริมาณ และมูลค่าของสินค้าเกษตรส่งออกที่สำคัญ ปี 2538-2541	2
1.3 ปริมาณ และมูลค่าส่งออกยางพาราของประเทศต่างๆที่สำคัญ พ.ศ. 2539-2541	2
1.4 ปริมาณการส่งออกมันสำปะหลังและผลิตภัณฑ์ของประเทศต่างๆที่สำคัญ ปี 2538-2542	3
1.5 ปริมาณการส่งออกข้าวโพดของประเทศต่างๆที่สำคัญ ปี 2538-2542	3
4.1 เนื้อที่ ผลผลิตและผลผลิตเฉลี่ยยางพารา ปี 2532-2541	26
4.2 การส่งออกยางพารา จำแนกตามประเภทตั้งแต่ปี 2539-2544	30
4.3 เนื้อที่ปลูก ผลผลิต และผลผลิตต่อไร่มันสำปะหลังในประเทศไทย ปี 2543-2542	33
4.4 เนื้อที่เพาะปลูกมันสำปะหลังของไทยแบ่งตามภูมิภาค ปี 2539-2542	34
4.5 ผลผลิตมันสำปะหลังของประเทศผู้ผลิตสำคัญ ปี 2540-2544	34
4.6 ปริมาณการส่งออกผลิตภัณฑ์มันสำปะหลังไทย ปี 2539-2543	37
4.7 ปริมาณการผลิตข้าวโพดของโลก ปี 2538-2542	39
4.8 ปริมาณการค้าข้าวโพดโลก ปี 2538-2542	40
4.9 บัญชีสมดุลข้าวโพดโลกปี 2539-2542	41
4.10 เนื้อที่ปลูก ผลผลิต และผลผลิตต่อไร่ข้าวโพดเลี้ยงสัตว์ในประเทศไทย ปี 2543-2542	42
4.11 เนื้อที่เพาะปลูกข้าวโพดเลี้ยงสัตว์ของไทยแบ่งตามภูมิภาค ปี 2539-2542	42
4.12 บัญชีสมดุลข้าวโพดไทยปี 2540-2542	43
4.13 ปริมาณและมูลค่าการส่งออกข้าวโพด ปี 2539-2541 แยกเป็นรายประเทศ	45
5.1 ราคาขายพาราที่ตลาดท้องถิ่นสงขลา ระหว่างปี 2537-2542	49
5.2 ราคาขายพาราที่ตลาดกลางหาดใหญ่ ระหว่างปี 2537-2542	50
5.3 ราคาขายพาราที่ตลาดท่าเรือส่งออก ระหว่างปี 2537-2542	51
5.4 ราคาขายพาราที่ตลาดประเทศสิงคโปร์ ระหว่างปี 2537-2542	52
5.5 ราคาขายพาราที่ตลาดประเทศมาเลเซีย ระหว่างปี 2537-2542	53
5.6 แสดงค่าสถิติ t ของ α_1 ของข้อมูลราคาขายพารา	58

5.7	ค่าสัมประสิทธิ์และค่าสถิติต่างๆจากผลการทดสอบ Cointegration ของข้อมูล ราคายางพารา ตามสมการ $\Delta \hat{\varepsilon}_t = \gamma \hat{\varepsilon}_{t-1} + \sum_{m=1}^p a_m \Delta \hat{\varepsilon}_{t-m} + v_t$	59
5.8	ค่าประมาณของสมการการกำหนดราคาในระยะยาว : long run price transmission ของข้อมูลราคายางพารา	61
5.9	ค่าสัมประสิทธิ์การกำหนดราคาและผลการทดสอบประสิทธิภาพ การกำหนดราคาของราคายางพารา	64
5.10	ผลการทดสอบความเร็วในการปรับตัวของราคาเพื่อเข้าสู่ดุลยภาพ ตามแบบจำลอง ECM ของตลาดยางพารา	66
5.11	สรุปผลการกำหนดราคายางพารา	69
5.12	ราคามันสำปะหลังที่ตลาดท้องถิ่น ระหว่างปี 2537-2542	70
5.13	ราคามันสำปะหลังที่ตลาดกลางชายฝั่งกรุงเทพฯ ระหว่างปี 2537-2542	71
5.14	ราคามันสำปะหลังที่ตลาดท่าเรือส่งออก ในช่วงปี 2537-2542	72
5.15	ราคามันสำปะหลังที่ตลาดสหภาพยุโรป ระหว่างปี 2537-2542	73
5.16	แสดงค่าสถิติ t ของ α_1 ของราคามันสำปะหลัง	76
5.17	ค่าสัมประสิทธิ์และค่าสถิติต่างๆจากผลการทดสอบ cointegration ของข้อมูล ราคามันสำปะหลังตามสมการ $\Delta \hat{\varepsilon}_t = \gamma \hat{\varepsilon}_{t-1} + \sum_{m=1}^p a_m \Delta \hat{\varepsilon}_{t-m} + v_t$	78
5.18	ค่าประมาณของสมการการกำหนดราคาในระยะยาว : long run price relationship ของราคามันสำปะหลัง	79
5.19	ค่าสัมประสิทธิ์การกำหนดราคาและผลการทดสอบประสิทธิภาพ การกำหนดราคามันสำปะหลัง	82
5.20	สรุปผลการทดสอบความเร็วในการปรับตัวของราคาเพื่อเข้าสู่ดุลยภาพ ตามแบบจำลอง ECM ของตลาดมันสำปะหลัง	84
5.21	สรุปผลการกำหนดราคามันสำปะหลัง	85
5.22	ราคาข้าวโพดที่ตลาดท้องถิ่น ระหว่างปี 2537-2542	87
5.23	ราคาข้าวโพดที่ตลาดกลางชายฝั่งกรุงเทพฯ ระหว่างปี 2537-2542	88
5.24	ราคาข้าวโพดที่ตลาดท่าเรือส่งออก ระหว่างปี 2537-2542	89
5.25	ราคาข้าวโพดที่ตลาดชิคาโก ระหว่างปี 2537-2542	90
5.26	แสดงค่าสถิติ t ของ α_1 ของของราคาข้าวโพด	93

- 5.27 ค่าสัมประสิทธิ์และค่าสถิติต่างๆจากผลการทดสอบ cointegration ของข้อมูล
ราคาข้าวโพดตามสมการ $\Delta \hat{\varepsilon}_t = \gamma \hat{\varepsilon}_{t-1} + \sum_{m=1}^p a_m \Delta \hat{\varepsilon}_{t-m} + v_t$ 94
- 5.28 ค่าประมาณของสมการการกำหนดราคาในระยะยาว : long run price relationship
ของข้อมูลราคาข้าวโพด 96
- 5.29 ค่าสัมประสิทธิ์การกำหนดราคาและผลการทดสอบประสิทธิภาพ
การกำหนดราคาข้าวโพด 98
- 5.30 ผลการทดสอบความเร็วในการปรับตัวของราคาเพื่อเข้าสู่ดุลยภาพ
ตามแบบจำลอง ECM ของตลาดมันสำปะหลัง 100
- 5.31 สรุปผลการกำหนดราคาระหว่างตลาดข้าวโพด 101

สารบัญภาพ

รูป	หน้า
5.1 ราคาขงพาราที่ระดับตลาดต่างๆ ระหว่างปี 2537-2542	54
5.2 ราคามันสำปะหลังที่ระดับตลาดต่างๆ ระหว่างปี 2537-2542	73
5.3 ราคาข้าวโพดที่ระดับตลาดต่างๆ ระหว่างปี 2537-2542	90



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright© by Chiang Mai University
 All rights reserved