

บทที่ 2

เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง

ศรุตฤทธิ สิริธัญญ์ (2540) ศึกษาพฤติกรรมการราคาและการพยากรณ์ราคาของสินค้าเกษตรที่สำคัญ 5 ชนิด ได้แก่ กล้วยไม้, ข้าว, ยางพารา, มันสำปะหลัง, ข้าวโพด, กุ้งกุลาดำ โดยมีวัตถุประสงค์ในการศึกษาคือเพื่อวิเคราะห์ประสิทธิภาพของการถ่ายทอดราคาของสินค้าเกษตรที่สำคัญโดยวิเคราะห์และพยากรณ์การเคลื่อนไหวราคาสินค้าด้วยแบบจำลองอาร์มา จากการศึกษาพบว่าอนุกรมเวลาของทุกราคาสามารถปรับให้เป็นอนุกรมเวลาที่มีเสถียรภาพได้ ซึ่งสามารถนำไปใช้พยากรณ์ราคาในอนาคตได้ ราคาสินค้าทุกชนิดมีแนวโน้มที่สูงขึ้น นอกจากนี้ยังพบว่าราคาข้าวเปลือกที่เกษตรกรได้รับและราคาข้าวโพดขายส่งตลาดกรุงเทพมหานครมีลักษณะเคลื่อนไหวตามฤดูกาลที่กินเวลาแบบ 12 เดือนสำหรับราคาหัวมันสำปะหลังที่เกษตรกรได้รับ และราคามันอัดเม็ดขายส่งกรุงเทพมหานครมีลักษณะการเคลื่อนไหวแบบวัฏจักร ใช้เวลา 16 เดือน ส่วนราคากุ้งกุลาดำจะเคลื่อนไหวแบบฤดูกาลเพียง 5 เดือน

ยุพา นาคา (2541) ศึกษาเรื่องศักยภาพและโอกาสของการจัดตั้งตลาดซื้อขายสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย โดยมีวัตถุประสงค์คือเพื่อศึกษาถึงศักยภาพ โอกาสและบทบาทของรัฐบาลในการจัดตั้งตลาดนี้ ซึ่งข้อมูลที่ใช้ได้แก่ การออกแบบสอบถาม ผลจากการศึกษาพบว่าศักยภาพการจัดตั้งตลาดซื้อขายสินค้าเกษตรล่วงหน้าในปี 2541 ค่อนข้างต่ำเนื่องจากผู้ที่เกี่ยวข้องกับการจัดตั้งตลาดนี้เป็นจำนวนมากยังไม่ทราบเรื่องการจัดตั้งตลาดนี้ทั้งๆที่กระทรวงพาณิชย์ได้ประชาสัมพันธ์ไปแล้ว การจัดตั้งตลาดมีข้อจำกัดอยู่คือขาดกฎหมายควบคุมตลาดซื้อขายสินค้าเกษตรล่วงหน้า ปัญหาด้านการขนส่ง การเก็บรักษา สถาบันเกษตรกรยังไม่เข้มแข็งพอ การประชาสัมพันธ์ยังไม่มากพอ ซึ่งรัฐบาลควรที่จะออกกฎหมายมาเพื่อรองรับควบคุมตลาดนี้ ควรมีการพัฒนาอย่างต่อเนื่องในทุกๆด้าน เพิ่มการเผยแพร่ประชาสัมพันธ์ สนับสนุนให้มีการศึกษาวิจัยด้านการผลิตและการตลาดสินค้าเกษตร นโยบายมาตรการด้านราคาและปริมาณสินค้าเกษตรต้องชัดเจน

สมภพ สิริประภา (2543) ศึกษาเรื่องพฤติกรรมการราคาเพื่อความพร้อมในการตัดสินใจราคาอนาคตสำหรับตลาดซื้อขายสินค้าเกษตรล่วงหน้ากรณีศึกษาสินค้ากุ้งกุลาดำของไทย โดยที่มีวัตถุประสงค์เพื่อศึกษาถึงสภาพทั่วไปของตลาดซื้อขายสินค้าเกษตรล่วงหน้า ภาวะการผลิต การค้า การส่งออกและพฤติกรรมการเคลื่อนไหวราคาสินค้ากุ้งกุลาดำของไทย โดยการทดสอบคุณสมบัติความเสถียรภาพของข้อมูลอนุกรมเวลา การทดสอบความสัมพันธ์เชิงคู่สภาพในระยะยาวและ

การทดสอบความสัมพันธ์เชิงเป็นเหตุเป็นผลของระบบการส่งผ่านราคาสินค้ากึ่งอุตสาหกรรมในและนอกประเทศ จากผลการศึกษาข้างต้นพบว่า การทดสอบคุณสมบัติความมีเสถียรภาพของข้อมูลอนุกรมเวลาเป็นส่วนสำคัญอย่างยิ่งสำหรับการเตรียมความพร้อมในการที่จะตัดสินใจในราคาอนาคตเนื่องจากอนุกรมเวลาของทุกราคาสินค้ากึ่งอุตสาหกรรมที่ทดสอบเมื่อปรับให้เป็นอนุกรมเวลาที่มีเสถียรภาพแล้วจะสามารถนำไปใช้ในการพยากรณ์ราคาในอนาคตได้อย่างมีประสิทธิภาพ อีกทั้งจากผลการทดสอบความสัมพันธ์เชิงเป็นเหตุเป็นผลยังทำให้ทราบว่าพฤติกรรมราคาสินค้ากึ่งอุตสาหกรรมมีการเคลื่อนไหวเข้าหากันในระยะสั้นในทิศทางที่กำหนดซึ่งกันและกัน

จุรีรัตน์ สรรค์วรรณะ (2547) ศึกษาเรื่องความเหมาะสมของการนำลำไยสดและลำไยอบแห้งเข้าซื้อขายในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อศึกษาถึงความเหมาะสมของการนำลำไยสดและลำไยอบแห้งเข้าซื้อขายในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย ซึ่งจากการศึกษาพบว่า การซื้อขายไม่ได้เอามาตรฐานลำไยไทยที่มีอยู่มาปฏิบัติอย่างจริงจัง ทำให้เกิดความคลาดเคลื่อนในการแบ่งเกรดระหว่างผู้ประการและเกษตรกร ส่วนปริมาณการซื้อขายในปัจจุบันยังมีปริมาณน้อยและพบว่ายังขาดข้อมูลปริมาณลำไยโดยแยกตามเกรดจึงทำให้การศึกษาด้านปริมาณลำไยที่ซื้อขายในปัจจุบันไม่สามารถระบุได้ว่าลำไยเกรดใดมีปริมาณซื้อขายมากที่สุด ผลการศึกษาตามหลักเกณฑ์ความเคลื่อนไหวของราคาพบว่าลำไยเกรด AA และเกรด BB มีความผันผวนของราคามากที่สุด จากการศึกษาปัจจัยสนับสนุนพบว่า ปัจจัยทางด้านเศรษฐกิจของลำไยนั้นผู้ประกอบการมีการรับรู้ข้อมูลข่าวสารเกี่ยวกับการผลิตและการค้าเป็นอย่างดีในขณะที่เกษตรกรยังมีการรับรู้ที่น้อยมาก ส่วนปัจจัยด้านการเก็บรักษาพบว่าทั้งลำไยสดและลำไยอบแห้งสามารถเก็บไว้ได้นาน จากการศึกษาทั้งปัจจัยหลักและปัจจัยสนับสนุนสรุปได้ว่า ลำไยสดและลำไยอบแห้งยังขาดความเหมาะสมในการนำเข้าสู่ซื้อขายในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย

दनัย พันโกฏฐิ (2547) ศึกษาเรื่องการจัดการธุรกิจโรงงานผลิตแป้งมันสำปะหลัง (แป้งดิบ) ในจังหวัดนครราชสีมา ซึ่งในการศึกษาครั้งนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อให้ทราบถึงกรรมวิธีการจัดการผลิตแป้งมันสำปะหลังดิบจากหัวมันสำปะหลังสด โดยเริ่มจากการจัดการด้านวัตถุดิบ การจัดการด้านการผลิต การจัดการด้านการตลาด ต้นทุนและผลตอบแทนในการผลิตแป้งมันสำปะหลังดิบของโรงงาน การคัดแปรรูปแป้งมันสำปะหลังเพื่อนำไปใช้ประโยชน์ ตลอดจนการนำเอาผลิตภัณฑ์จากแป้งมันสำปะหลังไปใช้ประโยชน์ในด้านต่างๆ ซึ่งจะใช้การวิเคราะห์เชิงพรรณนาและเชิงปริมาณ โดยการเก็บข้อมูลจากทฤษฎีภูมิและการสัมภาษณ์ผู้บริหารโรงงานที่ผลิตแป้งมันสำปะหลัง ซึ่งพบว่าการจัดการด้านวัตถุดิบจะตั้งราคาหัวมันสดที่จะรับซื้อที่ระดับแป้งสูงสุดที่ 30 เปอร์เซ็นต์ และระดับหัวมันสดที่รับซื้อจะลดลงจากราคาที่ตั้งไว้ทุกๆ 3 สตางค์ในทุกๆระดับเปอร์เซ็นต์แป้งในหัวมันสดที่ลดลง ในด้านของต้นทุนพบว่าโรงงานมีต้นทุนในการผลิตเฉลี่ย 2.0 บาทต่อกิโลกรัมทั้งในปี 2545

และปี 2546 ซึ่งความแตกต่างของต้นทุนขึ้นอยู่กับต้นทุนในการรับซื้อหัวมันและการควบคุมอัตรา การได้กลับคืนมาของการผลิต และในด้านของผลตอบแทนการผลิตแป้งมันสำปะหลังพบว่ากำไร เฉลี่ยในปี 2545 และปี 2546 เท่ากับ 1.39 และ 1.53 บาทต่อกิโลกรัมตามลำดับ และแป้งมัน สำปะหลังดิบที่ได้สามารถที่จะนำไปทำการตัดแปรรูปเพื่อใช้ในอุตสาหกรรมอื่นๆ ซึ่งมีวิธีการอยู่ 2 แนวทางคือ การตัดแปรรูปทางเคมี การตัดแปรรูปทางกายภาพ

เบญจพร อุสมบัตินิชย์ (2547) ศึกษาการพยากรณ์ราคาไก่เนื้อโดยวิธีอาร์มีา มีวัตถุประสงค์ 2 ประการคือ ศึกษาถึงลักษณะ โครงสร้างการผลิตและการตลาดไก่เนื้อในประเทศไทยและพยากรณ์ ราคาไก่เนื้อ โดยใช้แบบจำลองอาร์มีาซึ่งแบ่งเป็น 2 ชนิดคือ ราคาไก่เนื้อชนิดเนื้อออกกุดกระดุกและ เนื้อสันในโดยใช้ข้อมูลอนุกรมเวลารายสัปดาห์ตั้งแต่ 17 กรกฎาคม 2544 ถึง 26 พฤศจิกายน 2546 จากผลการศึกษาพบว่ารูปแบบของอาร์มีา(1,1,1)ของสินค้าเนื้อไก่กุดกระดุก และอาร์มีา(2,1,0) ของสินค้าเนื้อสันในมีความเหมาะสมที่จะเป็นตัวแทนของราคาสินค้าไก่เนื้อด้วยเหตุที่แบบจำลองนี้ มีค่าความคลาดเคลื่อนต่ำที่สุดและผลการพยากรณ์มีแนวโน้มในทิศทางเดียวกับข้อมูลจริง และเมื่อ ได้นำไปพยากรณ์เนื้อไก่กุดกระดุกล่วงหน้าจากสัปดาห์ที่ 1 - 4 เดือนธันวาคม 2548 จะได้ข้อมูล ดังนี้ 51.06115, 51.22589, 51.31597 และ 51.34826 บาทตามลำดับ ส่วนเนื้อสันในจะได้ข้อมูลดังนี้ 52.88084, 53.01172, 53.07473 และ 53.09098 บาทตามลำดับ

สมบัตินิชย์ สนิทจันทร์ (2547) ศึกษาเรื่องการพยากรณ์ราคาผลิตภัณฑ์มันสำปะหลังโดยวิธี อาร์มีา โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อพยากรณ์ราคาผลิตภัณฑ์มันสำปะหลังรายเดือน โดยใช้วิธีการ วิเคราะห์เชิงปริมาณด้วยแบบจำลองอาร์มีา จากการศึกษาที่ได้พบว่าการกำหนดรูปแบบการ พยากรณ์เพื่อให้ได้รูปแบบที่เหมาะสมที่สุดโดยพิจารณาจากคอเรลโลแกรม พบว่ามันแข็งได้ รูปแบบ AR(1) มีค่าสัมประสิทธิ์เท่ากับ 0.2152 โดยมีนัยสำคัญทางสถิติที่ระดับ 1% และแป้งมัน สำปะหลังได้รูปแบบ MA(4) MA(36) มีค่าสัมประสิทธิ์เท่ากับ -0.3347 และ 0.2477 ตามลำดับ โดย มีนัยสำคัญทางสถิติที่ระดับ 1% จากผลการตรวจสอบความถูกต้อง พบว่าทุกรูปแบบจำลองมี ลักษณะเป็น white noise ที่การทำสอบ ณ ระดับ 1% และเลือกรูปแบบที่มีค่า root mean squared error และค่า Theil's inequality coefficient ที่มีค่าต่ำสุด ดังนั้นค่าพยากรณ์ที่ได้ พบว่าราคามันเม็ด แข็งส่งออก เอฟ.โอ.บี.กรุงเทพฯ รายเดือน ตั้งแต่เดือนมกราคมถึงเดือนเมษายน พ.ศ. 2547 มีค่า เท่ากับ 82.13, 81.72 และ 81.52 เหรียญสหรัฐต่อตัน ตามลำดับ ราคาแป้งมันสำปะหลังส่งออกเอฟ. โอ.บี.กรุงเทพฯ รายเดือน ตั้งแต่เดือนมกราคมถึงเดือนเมษายน พ.ศ. 2547 มีค่าเท่ากับ 178.76, 176.04, 179.12 และ 177.53 เหรียญสหรัฐต่อตัน ตามลำดับ ดังนั้นเพื่อให้ผลการพยากรณ์จาก การศึกษามีความแม่นยำยิ่งขึ้นควรทำการศึกษาปัจจัยที่มีผลกระทบต่อราคาเพิ่มเติมประกอบกับการ พยากรณ์โดยวิธีอาร์มีา เพื่อเป็นแนวทางและประโยชน์ต่อเกษตรกรผู้ส่งออกในการตัดสินใจวาง แผนการผลิตและการส่งออกเพื่อให้สอดคล้องกับความต้องการของตลาด

สวันญา เสนารัตน์ (2547) ศึกษาเรื่องการพยากรณ์ราคาทุเรียนโดยใช้ข้อมูลอนุกรมเวลาตั้งแต่เดือนกรกฎาคม 2531 ถึงเดือนกันยายน 2546 เมื่อทดสอบความนิ่งของข้อมูลโดยวิธี unit root และทำการปรับความนิ่งโดยการหาผลต่างลำดับที่ 1 แล้วผลการศึกษาพบว่าแบบจำลองที่เหมาะสมสำหรับทุเรียนขนาดใหญ่ คือ MA(2) และ MA(9) ส่วนทุเรียนขนาดกลางคือ AR(1) และ AR(35) โดยแบบจำลองนี้มีค่าความคลาดเคลื่อนต่ำที่สุดและทำการพยากรณ์ราคาล่วงหน้า 3 เดือนคือ ตุลาคม พฤศจิกายน และธันวาคม 2546 โดยทุเรียนขนาดใหญ่มีราคาเท่ากับ 273.13, 277.52 และ 280.43 บาทต่อกิโลกรัม ส่วนทุเรียนขนาดกลางมีราคา 224.66, 225.78 และ 227.76 บาทต่อกิโลกรัม ตามลำดับ

ขจรศักดิ์ อักษรเสื่อ (2548) ศึกษาการพยากรณ์มูลค่าการส่งออกรถยนต์และชิ้นส่วนโดยวิธีอาร์ไอมาใช้ข้อมูลรายเดือนมกราคม 2537 ถึงกุมภาพันธ์ 2548 จากการศึกษาพบว่าการตรวจสอบคอเรลโลแกรมผลปรากฏว่าแบบจำลอง AR(1) AR(11) MA(12) ซึ่งเป็นข้อมูลรายเดือนมีความเหมาะสมที่สุด และแบบจำลอง AR(1) AR(2) MA(2) MA(12) ซึ่งเป็นข้อมูลรายไตรมาสมีความเหมาะสมที่สุด เนื่องจากเมื่อทำการตรวจสอบความถูกต้องของแบบจำลองพบว่า แบบจำลองมีลักษณะเป็น white noise ณ ระดับนัยสำคัญทางสถิติที่ 0.05 และแบบจำลองนี้ให้ค่า root mean squared error และ Theil inequality coefficient ที่ต่ำที่สุด ดังนั้นแบบจำลองดังกล่าวจึงมีความเหมาะสมที่สุดในการพยากรณ์มูลค่าการส่งออกรถยนต์และชิ้นส่วนในอนาคต ซึ่งจากการพยากรณ์พบว่าระหว่างเดือนมีนาคม 2548 ถึงเดือนกรกฎาคม 2548 มีค่าเท่ากับ 9115.731, 8462.585, 8478.536, 9704.225 และ 9545.694 ล้านบาทตามลำดับ และระหว่างไตรมาส 2 ปี2548 ถึงไตรมาสที่ 4 ปี2548 มีค่าเท่ากับ 28,837.29, 32,590.42 และ 32,098.91 ล้านบาท ตามลำดับ

ดวงธิดา ไชยวิภาสสาร (2548) ศึกษาการพยากรณ์ดัชนีราคาเหล็กโดยวิธีอาร์ไอ ใช้ข้อมูลเป็นรายเดือนตั้งแต่เดือนมกราคม 2538 ถึงเดือนตุลาคม 2547 จากผลการศึกษาพบว่าเมื่อทำการตรวจสอบความถูกต้องของแบบจำลองแล้วรูปแบบ AR(1) MA(3) MA(6) MA(10) MA(16) เป็นแบบจำลองที่มีลักษณะเป็น white noise ณ ระดับนัยสำคัญทางสถิติที่ 0.10 และแบบจำลองนี้ให้ค่า root mean squared error และ Theil inequality coefficient ที่ต่ำที่สุด ดังนั้นแบบจำลองดังกล่าวจึงมีความเหมาะสมที่สุดในการพยากรณ์ดัชนีราคาเหล็กในอนาคต และจากการพยากรณ์ในอนาคตพบว่าระหว่างเดือนพฤศจิกายน 2547 ถึงเดือนกุมภาพันธ์ 2548 มีดัชนีราคาอยู่ที่ 202.1984, 199.8297, 202.1645 และ 204.5491 ตามลำดับ