

บทที่ 2

เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง

อร จุนธิระพงษ์ (2543) ศึกษาความสำคัญของการผลิตยางพาราที่มีต่อระบบเศรษฐกิจและประสิทธิภาพการผลิต ผลกระทบจากโรคที่เกิดต่อยางพารา ตลอดจนผลกระทบทางสังคมต่อการผลิตยางพารา โดยพื้นที่ศึกษาอยู่ในเขตภาคตะวันออกเฉียงเหนือ ซึ่งเป็นเขตปลูกยางพาราใหม่ เกษตรกรไม่มีความแตกต่างในเรื่องการปลูก การดูแลสวนยางพารามากนัก และเป็นเขตพื้นที่ที่มีความเสี่ยงต่อการเกิดโรคมามากกว่าภาคใต้และภาคตะวันออก กลุ่มตัวอย่างที่ถูกเลือก คือจังหวัดหนองคาย เลย และบุรีรัมย์ รวม 160 ตัวอย่าง การศึกษาใช้สมการการผลิต และวิธีการประมาณสมการพรมแดนการผลิตด้วยวิธีstochastic พบว่าสามารถประมาณค่าสัมประสิทธิ์ของโรคได้และมีความเป็นลบ แสดงให้เห็นว่าเมื่อต้นยางเกิดโรคทำให้ผลผลิตที่ได้รับลดลง

ส่วนผลกระทบของอุตสาหกรรมยางพาราที่มีต่อระบบเศรษฐกิจวิเคราะห์โดยใช้แบบจำลอง input - output ประเมินราคา 2 ระดับคือ ราคาผู้ซื้อและราคาผู้ผลิตในปี พ.ศ. 2533 และปี พ.ศ. 2538 และเลือกตัวแทนของอุตสาหกรรมยางพาราจาก สาขาการทำสวนยางพารา และสาขาการแปรรูปยางอย่างง่าย จำนวน 60 สาขาการผลิต จากการศึกษาพบว่าเมื่ออุปสงค์ขั้นสุดท้ายของทั้ง 2 สาขามีการเปลี่ยนแปลงจะส่งผลกระทบต่อมูลค่าผลผลิต มูลค่าเพิ่ม และมูลค่าการจ้างงานของสาขาการผลิตต่างๆ ให้มีการเปลี่ยนแปลงเพิ่มขึ้นต่ำกว่า 10 เปอร์เซ็นต์ และผลกระทบทางด้านสังคมต่อเกษตรกรผู้ปลูกยางในภาคตะวันออกเฉียงเหนือ พบว่ากลุ่มเกษตรกรตัวอย่างมีสถานภาพด้านสังคม ความเป็นอยู่ ตลอดจนคุณภาพชีวิตที่ดีขึ้นหลังจากเปลี่ยนมาปลูกยางพารา

ผัยรัตน์ ภาสณฑ์พัฒนกุล (2544) การศึกษาความสัมพันธ์ระหว่างราคายางพาราแผ่นรมควันตลาดส่งมอบทันทีในประเทศไทยกับราคายางพาราตลาดส่งมอบล่วงหน้าในต่างประเทศ โดยการศึกษาพฤติกรรมของยางพาราแผ่นรมควัน ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษาเป็นข้อมูลรายวัน (ระหว่างเดือนมิถุนายน 2537 – กุมภาพันธ์ 2543 เฉพาะวันทำการ) ของราคายางพาราแผ่นรมควันชั้น 1 (RSS1) และราคายางพาราแผ่นรมควันชั้น 3 (RSS3) ในตลาดที่สำคัญ 3 ตลาดในประเทศไทย ได้แก่ ราคา ณ ตลาดกลางหาดใหญ่ ราคาส่งออก (F.O.B) ที่ท่าเรือกรุงเทพฯ และราคาส่งออก (F.O.B) ณ ท่าสงขลาเป็นตัวแทนราคาในตลาดส่งมอบทันที ตัวแปรราคาในตลาดล่วงหน้าที่ใช้คือ ราคายางพาราแผ่นรมควันชั้น 1 และชั้น 3 ที่ตลาดลอนดอน กัวลาลัมเปอร์ นิวยอร์ก สิงคโปร์ ตลาดโกเบ และตลาดโตเกียว และใช้วิธี vector autoregressive model (VAR) และ vector error correction

model (VEC) ศึกษาประสิทธิภาพของตลาดโดยวิธี cointegration และ error correction mechanism (ECM) ผลการศึกษาพบว่าราคาในตลาดล่วงหน้าของพาราในต่างประเทศนั้น ตลาดสิงคโปร์สามารถนำมาอธิบายราคาส่งมอบทันทีในอนาคตได้อย่างมีประสิทธิภาพสำหรับราคาของพาราแผ่นรมควันชั้น 1 และชั้น 3 ณ ตลาดขนาดใหญ่ และราคาส่งออก ณ ท่าเรือกรุงเทพ ใช้ตลาดกัวลาลัมเปอร์และสิงคโปร์ ในการอธิบายราคาของพาราชั้น 1 และใช้ตลาดกัวลาลัมเปอร์ สิงคโปร์ ลอนดอน สำหรับยางแผ่นรมควันชั้น 3 ส่วนราคาส่งออก ณ ท่าเรือสงขลา สามารถใช้ราคาตลาดกัวลาลัมเปอร์ สิงคโปร์ ลอนดอน ได้ทั้งยางแผ่นรมควันชั้น 1 และชั้น 3

คัดนา กันตะพัฒนา (2546) ศึกษาถึงการกำหนดราคาของพารา โดยอาศัยคุณภาพในตลาดสหรัฐ และสิงคโปร์ว่ามีความแตกต่างกันอย่างไร โดยเลือกผลิตภัณฑ์ยางพาราแผ่นรมควัน ซึ่งเป็นผลิตภัณฑ์ที่ทำกรส่งออกมากที่สุด ลักษณะของข้อมูลที่ใช้ศึกษาเป็นข้อมูลรายสัปดาห์ตั้งแต่เดือนมกราคม พ.ศ.2538 ถึงเดือนมกราคม พ.ศ.2543 จำนวน 1,568 ตัวอย่าง ผลการศึกษาจากการทดสอบ unit root และใช้วิธี cointegration พบว่าข้อมูลราคาของพาราของประเทศไทยในตลาดสหรัฐ และตลาดสิงคโปร์มีลักษณะนี้ นอกจากนั้นความขึ้นซึ่งใช้แทนคุณภาพของพารา มีผลกระทบต่อระดับราคาของพาราอย่างมีนัยสำคัญ และยังพบว่า การเปลี่ยนแปลงของคุณภาพของพารา นั้น จะส่งผลกระทบต่อราคาตลาดสหรัฐมากกว่าตลาดสิงคโปร์ เนื่องจากจุดประสงค์ของการซื้อขายในตลาดสหรัฐอเมริกา คือการนำไปใช้เป็นวัตถุดิบในอุตสาหกรรม แต่จุดประสงค์ของตลาดสิงคโปร์เป็นการซื้อขายเพื่อเก็งกำไร

พริยา ชูตยากร (2547) วิเคราะห์พฤติกรรมกรส่งผ่านราคาข้าวในตลาดระดับต่างๆ ของประเทศว่ามีทิศทาง ระยะเวลาการส่งผ่านราคาอย่างไร และการประมาณความสัมพันธ์ระหว่างราคาข้าวในตลาดล่วงหน้าต่างประเทศ กับราคาข้าวตลาดส่งมอบทันทีในประเทศไทย เพื่อทราบว่าราคาตลาดล่วงหน้าในต่างประเทศเป็นตัวพยากรณ์ราคาในตลาดส่งมอบทันทีในประเทศไทยได้ดีเพียงใด โดยศึกษาจากข้อมูลรายสัปดาห์ตั้งแต่ปี 2541 ถึงปี 2546 ประกอบด้วยราคาข้าวขาว 5% จาก 3 ตลาด ได้แก่ ราคาที่เกษตรกรได้รับ ราคาขายส่ง ณ ตลาดกรุงเทพฯ และราคาส่งออก (F.O.B) ส่วนข้อมูลราคาในตลาดล่วงหน้าใช้ราคาข้าวเปลือกชั้นสอง ณ ตลาดล่วงหน้า Chicago Broad of Trade (CBOT)

การศึกษาถึงทิศทางและระยะเวลาในการส่งผ่านข้อมูลราคาในตลาดระดับต่างๆ ในประเทศ ใช้วิธี vector autoregressive model (VAR) และ vector error correction model (VEC) พบว่าราคาในตลาดระดับต่างๆ มีคุณภาพระยะยาว ส่วนการศึกษาประสิทธิภาพตลาด และการประมาณที่ไม่

เอนเอียงของตลาดล่วงหน้าข้าวขาว 5% เพื่อทดสอบความสัมพันธ์ของราคาข้าวในตลาดส่งมอบทันทีในประเทศไทย ใช้วิธี cointegration พบว่าราคาข้าวขาว 5% ส่งมอบทันทีกับราคาข้าวในตลาดล่วงหน้า Chicago Broad of Trade (CBOT) มีความสัมพันธ์กัน ซึ่งหมายความว่าตลาดล่วงหน้ามีประสิทธิภาพ

ชีวิน กันธอ้าย (2547) ศึกษาถึงการพยากรณ์ราคาขางพาราแผ่นรมควันชั้น 1 (RSS1) และชั้น 3 (RSS3) ซึ่งพยากรณ์ด้วยข้อมูลรายเดือนตั้งแต่ปี 2538 ถึง 2546 รวมทั้งสิ้น 108 ข้อมูล โดยใช้แบบจำลองอาร์มีมา จากการทดสอบ unit root ของ RSS1 และ RSS3 ผลการตรวจสอบคอเรลโลแกรมเพื่อค้นหาแบบจำลองที่เหมาะสม พบว่าแบบจำลอง AR(1) MA(1) MA(2) ของข้อมูล RSS1 และ AR(1) MA(1) MA(2) ของข้อมูล RSS3 โดยพิจารณาระดับนัยสำคัญที่ 1% และเมื่อตรวจสอบความถูกต้องของแบบจำลอง พบว่าแบบจำลองมีลักษณะเป็น white noise มีนัยสำคัญที่ 1% อีกทั้งแบบจำลองนี้ให้ค่า root mean squared error (RMSE) และ Theil inequality coefficient (U) ที่ต่ำที่สุด ดังนั้นแบบจำลองดังกล่าวจึงเหมาะสมที่สุดในการพยากรณ์ราคาของ RSS1 และ RSS3 ในอนาคต ซึ่งราคาในอนาคตของ RSS1 ระหว่างเดือนมกราคม 2547 ถึง มีนาคม 2547 เท่ากับ 52.05 , 50.94 และ 51.85 บาท/กก. ตามลำดับ และ ราคาในอนาคตของ RSS3 ระหว่างเดือนมกราคม 2547 ถึง มีนาคม 2547 เท่ากับ 50.89 , 49.79 และ 50.69 บาท/กก. ตามลำดับ

ธเนศ สุนทรโรปกรณ์ (2548) ศึกษาถึงการพยากรณ์มูลค่าการส่งออกเสื้อผ้าสำเร็จรูป (GAR) ซึ่งพยากรณ์ด้วยข้อมูลรายเดือนตั้งแต่เดือนมกราคม 2537 ถึงเดือนกุมภาพันธ์ 2548 รวมทั้งสิ้น 134 ข้อมูล และข้อมูลรายไตรมาสตั้งแต่ไตรมาสที่ 1 ของปี พ.ศ.2537 ถึงไตรมาสที่ 1 ของปี พ.ศ.2548 รวมทั้งสิ้น 45 ข้อมูล โดยใช้แบบจำลองอาร์มีมา จากการทดสอบ unit root ของ GAR ผลการตรวจสอบคอเรลโลแกรมเพื่อค้นหาแบบจำลองที่เหมาะสมพบว่าแบบจำลอง AR(1) AR(13) MA(12) ซึ่งเป็นข้อมูลรายเดือน และ AR(2) SAR(4) MA(9) ซึ่งเป็นข้อมูลรายไตรมาส โดยพิจารณา ระดับนัยสำคัญที่ 1% และเมื่อตรวจสอบความถูกต้องของแบบจำลอง พบว่าแบบจำลองมีลักษณะเป็น white noise มีนัยสำคัญที่ 1% อีกทั้ง แบบจำลองนี้ให้ค่า root mean squared error (RMSE) และ Theil inequality coefficient (U) ที่ต่ำที่สุด ดังนั้นแบบจำลองดังกล่าวจึงเหมาะสมที่สุดในการพยากรณ์ราคาเสื้อผ้าสำเร็จรูปของในอนาคต ซึ่งราคาในอนาคตของ GAR ระหว่างเดือนมีนาคม 2548 ถึง พฤษภาคม 2548 เท่ากับ 8,801.965 , 7,303.122 และ 9,268.287 ล้านบาทตามลำดับ และ ราคาในอนาคตของ GAR ระหว่างไตรมาสที่ 2 ถึงไตรมาสที่ 4 ของปี พ.ศ.2548 เท่ากับ 26,398.77 , 35,262.43 และ 31,199.32 ล้านบาท ตามลำดับ

เบญจพร อุ่สมบัตินัย (2547) ศึกษาถึงลักษณะโครงสร้างการผลิตและการตลาดไก่เนื้อในประเทศไทย และเพื่อพยากรณ์ราคาของสินค้าไก่เนื้อโดยใช้แบบจำลองอาร์มีนา ซึ่งแบ่งเป็น 2 ชนิด คือ ราคาไก่เนื้อชนิดเนื้อออกดอกกระดูก และเนื้อสันใน โดยใช้ข้อมูลรายสัปดาห์ตั้งแต่วันที่ 17 กรกฎาคม 2544 ถึงวันที่ 26 พฤศจิกายน 2546 รวมทั้งสิ้น 135 ข้อมูล โดยเนื่องจากข้อมูลเป็นอนุกรมเวลา จึงทำการทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit root test) พบว่าข้อมูลนี้ที่ระดับ $I(1)$ และจากการพิจารณาโคเรโลแกรม (Correlogram) พบว่ารูปแบบอาร์มีนา $(1,1,1)$ และอาร์มีนา $(2,1,0)$ มีความเหมาะสมมากที่สุดที่จะเป็นตัวแทนของราคาไก่เนื้อชนิดเนื้อออกดอกกระดูก และราคาของเนื้อสันใน ตลอดจนผลการทดสอบด้วยวิธีที (t-statistic) พบว่ามีค่าทางสถิติแตกต่างจากศูนย์อย่างมีนัยสำคัญ และด้วยวิธีบอกส์และเพียร์ส์ (Box-Pierce) พบว่ามีค่าทางสถิติไม่เท่ากับศูนย์ที่ระดับความเชื่อมั่นร้อยละ 10 อีกทั้งการใช้ค่า root mean squared error (RMSE) และTheil inequality coefficient (U) มาเปรียบเทียบกับแบบจำลองเพื่อที่หาความแม่นยำในการพยากรณ์ ซึ่งให้ค่าสถิติที่น้อยที่สุด