

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญ	ช
สารบัญตาราง	ฉ
สารบัญภาพ	ฐ
บทที่ 1 บทนำ	1
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	3
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ	3
1.4 ขอบเขตการศึกษา	3
1.5 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	4
1.6 นิยามศัพท์เฉพาะ	4
บทที่ 2 โครงสร้างการตลาดข้าว	6
2.1 อุปทาน	6
2.2 อุปสงค์	11
2.3 การส่งออก	14
2.4 การตลาดข้าวภายในประเทศ	17
2.5 วิธีการตลาดข้าว	21
2.6 การกำหนดราคาข้าว	23
2.7 นโยบายสนับสนุนทางการตลาดของรัฐบาล	25

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright © by Chiang Mai University
 All rights reserved

สารบัญ (ต่อ)

	หน้า
บทที่ 3 ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้า	26
3.1 ความหมายของตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้า	26
3.2 ตลาดล่วงหน้าข้าวของโลก	26
3.3 ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าในประเทศไทย	29
บทที่ 4 งานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	
4.1 การศึกษาการจัดตั้งตลาดล่วงหน้าในประเทศไทย	41
4.2 การส่งผ่านราคาและพฤติกรรมราคาสินค้าเกษตร	42
4.3 การวิเคราะห์ประสิทธิภาพตลาด	47
บทที่ 5 ทฤษฎีและแนวคิดในการศึกษา	54
5.1 ความนิ่งและความไม่นิ่ง	54
5.2 การทดสอบ unit root	55
5.3 cointegration และ Error correction model	57
5.4 ทฤษฎีประสิทธิภาพตลาด	63
5.5 การทดสอบประสิทธิภาพตลาด	64
5.6 ข้อสมมติเกี่ยวกับ risk premium และการประมาณที่ไม่เอนเอียง	71
5.7 ความหมายในการทดสอบสมมติฐานประสิทธิภาพตลาด การประมาณที่ไม่เอนเอียง	71
5.8 แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา	72
บทที่ 6 ผลการศึกษา	76
6.1 พฤติกรรมราคาข้าวในประเทศไทย	76
6.2 ประสิทธิภาพตลาดล่วงหน้า	92

สารบัญ (ต่อ)

	หน้า
บทที่ 7 สรุปผลการศึกษา	105
7.1 พฤติกรรมราคาข้าวในประเทศไทย	105
7.2 ประสิทธิภาพตลาดล่วงหน้า	108
7.3 ข้อเสนอแนะทางนโยบาย	109
7.4 ข้อเสนอแนะสำหรับงานวิจัยในอนาคต	110
เอกสารอ้างอิง	111
ภาคผนวก	116
ภาคผนวก ก การจัดชั้นมาตรฐานของข้าว	117
ภาคผนวก ข ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	120
ภาคผนวก ค ผลการวิเคราะห์โดยใช้โปรแกรม EVIEW 4.1	126
ประวัติผู้เขียน	134

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
2.1 พื้นที่เก็บเกี่ยว ผลผลิต การค้า การบริโภครวมและสต็อกข้าวของโลก การเพาะปลูก 2536/37 – 2545/46	6
2.2 ผลผลิตข้าวสารของโลกปีการเพาะปลูก 2542/43 - 2545/46	8
2.3 เนื้อที่เพาะปลูก ผลผลิต ผลผลิตต่อไร่ ข้าวรวม (นาปีและนาปรัง) ปีเพาะปลูก 2540/41 – 2544/45	10
2.4 ความต้องการบริโภคข้าวของโลก ปีการเพาะปลูก 2542/43 – 2545/46	12
2.5 บัญชีสมดุลข้าวไทย ปีการค้า (พฤศจิกายน - ตุลาคม) ปี 2541/42 – 2543/44	14
2.6 ปริมาณและมูลค่าส่งออกข้าวตั้งแต่ปี 2540 – 2545	15
2.7 การส่งออกข้าวไทยแยกรายทวีปปี 2541 – 2545	16
2.8 การส่งออกข้าวของประเทศไทยแยกประเภทตั้งแต่ปี 2541 – 2544	17
3.1 แสดงปริมาณการซื้อขายสินค้าเกษตรของ The Chicago Board Of Trade	27
3.2 สรุปจำนวนและความจุของไซโล คลังสินค้า และยุ้งฉางสำหรับข้าว	33
3.3 การเปรียบเทียบข้อกำหนดการซื้อขายระหว่างตลาดล่วงหน้า ในประเทศไทย กับ The Chicago Board of Trade	34
6.1 ค่าสถิติของราคาข้าวขาว 5 % ในตลาดระดับต่างๆ	77
6.2 unit root ของตัวแปรราคาข้าวในตลาดระดับต่างๆ	78
6.3 ผลการทดสอบสมการ VAR ในระดับ lag order ต่างๆ สำหรับข้าวขาว 5 %	80
6.4 ค่าสัมประสิทธิ์และค่าสถิติบนพื้นฐานสมการ VAR ที่มี lags เท่ากับ 2 ของ ราคาข้าวเปลือก 5% ที่เกษตรกรได้รับ	81
6.5 ค่าสัมประสิทธิ์และค่าสถิติบนพื้นฐานสมการ VAR ที่มี lags เท่ากับ 2 ของราคาขายส่งข้าวขาว 5 % ที่ตลาดกรุงเทพฯ	82
6.6 ค่าสัมประสิทธิ์และค่าสถิติบนพื้นฐานสมการ VAR ที่มี lags เท่ากับ 2	83
6.7 ผลการประมาณค่าสมการถดถอยของความสัมพันธ์ของราคาข้าวขาว 5% ในตลาดระดับต่างๆ	85
6.8 Johansen and Juselius Cointegrating test โดยมี lag order = 2	88

สารบัญตาราง (ต่อ)

ตาราง	หน้า
6.9 ค่าสัมประสิทธิ์ของสมการ cointegration equation ของ ราคาส่งออกข้าวขาว 5 % FOB.	88
6.10 สัมประสิทธิ์และค่าสถิติจากสมการ VEC ที่มี lags เท่ากับ 2 ของสมการการปรับตัวยาระยะสั้นราคาข้าวขาว 5 % ส่งออก F.O.B.	91
6.11 ผลการทดสอบ unit root ของตัวแปรตลาดส่งมอบทันทีและตลาดล่วงหน้า	94
6.12 ค่าประมาณความสัมพันธ์ระยะยาวระหว่างราคาตลาดส่งมอบทันที และราคาตลาดล่วงหน้าย้อนหลัง 2-7 สัปดาห์	95
6.13 unit root test สำหรับ residual ที่ได้จากสมการในตาราง 6.12 เพื่อทดสอบความเป็น cointegration ของสมการ	96
6.14 ผลการทดสอบสมมติฐานการประมาณที่ไม่เอนเชิงของ ราคาตลาดส่งมอบทันทีกับราคาตลาดล่วงหน้า	98
6.15 ประมาณความสัมพันธ์ระยะสั้นระหว่างราคาข้าวตลาดส่งมอบทันที และราคาตลาดล่วงหน้าจากแบบจำลอง ECM	99
6.16 ผลการทดสอบ unit root ของตัวแปร risk premium (SD)	100
6.17 ค่าประมาณความสัมพันธ์ระหว่างราคาตลาดส่งมอบทันทีและราคา ตลาดล่วงหน้าย้อนหลัง 2 –7 สัปดาห์ในกรณีมี risk premium	101
6.18 unit Root Test สำหรับ Residual จากสมการในตาราง 6.17 เพื่อทดสอบการ เป็น cointegration ของสมการ	102
6.19 ผลการทดสอบสมมติฐานการประมาณที่ไม่เอนเชิงของราคาตลาด ส่งมอบทันทีกับราคาตลาดล่วงหน้า	103
6.20 ประมาณความสัมพันธ์ระยะสั้น โดยในกรณีมี risk premium	104

สารบัญภาพ

ภาพ	หน้า
2.1 สัดส่วนการใช้ประโยชน์ข้าวในประเทศไทย	10
2.2 วิธีการตลาดข้าว	22
3.1 แสดงปริมาณการซื้อขายสัญญาล่วงหน้าของ CBOT	28
5.1 การศึกษาพฤติกรรมการณ์ส่งผ่านราคาข้าว	74
5.2 การศึกษาความสัมพันธ์ระหว่างตลาดล่วงหน้าในต่างประเทศ (CBOT) กับราคาระดับส่งออกของประเทศไทย	75
6.1 แสดงการเปรียบเทียบราคาแท้จริงของราคาข้าวขาว 5%ที่เกษตรกรได้รับ กับราคาที่ได้จากการประมาณบนพื้นฐานของ VAR model และสมการถดถอย	86
6.2 แสดงการเปรียบเทียบราคาแท้จริงของราคาขายส่งข้าวขาว 5%ที่ตลาดกรุงเทพฯ กับราคาที่ได้จากการประมาณบนพื้นฐานของ VAR model และสมการถดถอย	86
6.3 แสดงการเปรียบเทียบราคาแท้จริงของราคาข้าวขาว 5%ส่งออกF.O.B กับราคาที่ได้จากการประมาณบนพื้นฐานของ VAR model และสมการถดถอย	86