

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ก
บทคัดย่อ (ภาษาไทย)	ง
บทคัดย่อ (ภาษาอังกฤษ)	ฉ
สารบัญ	ช
สารบัญตาราง	ฅ
สารบัญภาพ	ฒ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	6
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ	6
1.4.กรอบแนวคิดและวิธีการศึกษา	
1.4.1 การออกแบบวิจัย	7
1.4.2 ขอบเขต	8
1.4.3 วิธีการวิจัย	8
1.5 แหล่งข้อมูลวิจัย	9
บทที่ 2 วรรณกรรมปริทัศน์	
2.1 งานวิจัยที่เกี่ยวข้องกับการประมาณค่าความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยน	10
2.2 งานวิจัยที่วิเคราะห์ความสัมพันธ์และผลกระทบต่อสินค้าทางการเกษตร	11

ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

สารบัญ (ต่อ)

	หน้า
บทที่ 3 ทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง	
3.1 ทฤษฎีที่อธิบายถึงผลกระทบของอัตราแลกเปลี่ยนและการค้าระหว่างประเทศ	
3.1.1 การส่งผ่านอัตราแลกเปลี่ยนในตลาดแข่งขันไม่สมบูรณ์	18
3.1.2 การส่งผ่านอัตราแลกเปลี่ยน ในตลาดแข่งขันสมบูรณ์	19
3.2 ทฤษฎีการวิเคราะห์ข้อมูลอนุกรมเวลา และความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยน	
3.2.1 การทดสอบความนิ่งของข้อมูลอนุกรมเวลาแบบฤดูกาล (Seasonal unit root test)	20
3.2.2 การประมาณความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยน (Exchange rate volatility theory)	23
3.3 ทฤษฎีเกี่ยวกับการวิเคราะห์ความสัมพันธ์คู่ระยะยาว (Co-integration theory)	
3.3.1 ความสัมพันธ์เชิงคู่ระยะยาว (Co-integration)	26
3.3.2 การทดสอบ Impulse Response Function	30
3.3.3 การทดสอบ Variance Decomposition	32
บทที่ 4 วิธีการวิจัย	
4.1 ตัวแปรเบื้องต้นที่ใช้ในวิธีการวิจัยในการศึกษา	35
4.2 วิธีการวิจัยในการศึกษา	
4.2.1 การศึกษาลักษณะการค้าและสถานการณ์การส่งออกข้าว ของประเทศไทยกับประเทศผู้นำเข้าของไทย	36
4.2.2 การวิเคราะห์ความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยน	37
4.2.3 การศึกษาความสัมพันธ์ในคู่ระยะยาว (Co-integration)	38

สารบัญ (ต่อ)

	หน้า
บทที่ 5 ลักษณะการค้าและสถานการณ์ส่งออกข้าวของประเทศไทย	
5.1 ลักษณะการค้าและสถานการณ์ส่งออกข้าวของประเทศไทย	42
5.2 ลักษณะการค้าและสถานการณ์ส่งออกข้าวหอมมะลิของประเทศไทย	45
5.3 นโยบายข้าวในประเทศไทย	57
5.4 ปัญหาและการแก้ไขในการส่งออกข้าว	60
บทที่ 6 ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล โดยวิธียูนิทรูทแบบฤดูกาล และความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศไทยนำเข้า	
6.1 ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล โดยวิธียูนิทรูทแบบฤดูกาล (Seasonal unit root test)	62
6.2 ผลการประมาณค่าความผันผวนจากแบบจำลอง ARIMA - GARCH	
6.2.1 กรณี สหรัฐอเมริกา	66
6.2.2 กรณี ประเทศจีน	68
6.2.3 กรณี ประเทศฮ่องกง	70
บทที่ 7 ผลการทดสอบความสัมพันธ์คู่คลยภาพในระยะยาว	
7.1 ผลการทดสอบความสัมพันธ์เชิงคู่คลยภาพระยะยาว (Co-integration) กรณีประเทศไทยอเมริกา	72
7.2 ผลการทดสอบความสัมพันธ์เชิงคู่คลยภาพระยะยาว (Co-integration) กรณีประเทศจีน	81
7.3 ผลการทดสอบความสัมพันธ์เชิงคู่คลยภาพระยะยาว (Co-integration) กรณีประเทศฮ่องกง	89

สารบัญ (ต่อ)

	หน้า
บทที่ 8 บทสรุปและข้อเสนอแนะ	
8.1 สรุปลักษณะการค้าและสถานการณ์ส่งออกข้าวของประเทศไทย กับประเทศผู้นำเข้าข้าวของไทย	99
8.2 ผลการทดสอบความนิ่งโดยวิธียูนิทรูทแบบจุดคูณ	100
8.3 สรุปผลการศึกษา กรณีประเทศสหรัฐอเมริกา	101
8.4 สรุปผลการศึกษา กรณีประเทศจีน	103
8.5 สรุปผลการศึกษา กรณีประเทศฮ่องกง	105
8.6 ข้อเสนอแนะ	107
8.7 ข้อเสนอแนะเพิ่มเติมในการศึกษาครั้งต่อไป	107
เอกสารอ้างอิง	109
ภาคผนวก	
ภาคผนวก ก	115
ภาคผนวก ข	118
ภาคผนวก ค	123
ภาคผนวก ง	125
ภาคผนวก จ	156
ภาคผนวก ฉ	172
ประวัติผู้เขียน	175

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
1.1 มูลค่าและสัดส่วนการส่งออกคิดเป็นร้อยละของปริมาณ การส่งออกทั้งหมดของประเทศไทย	1
1.2 มูลค่าและสัดส่วนการส่งออกข้าวหอมมะลิ ชั้น 2 ของประเทศไทยรายประเทศ	5
2.1 สรุปวรรณกรรมที่เกี่ยวข้อง	14
3.1 การทดสอบสมมติฐานการหาจำนวน Co-integrating vectors	29
5.1 ปริมาณและมูลค่าการส่งออกข้าวแยกตามชนิดและคุณภาพข้าว	44
5.2 มูลค่าการส่งออกข้าวของไทยไปยังประเทศต่างๆ 10 อันดับแรกเรียงตามมูลค่าสูงสุด	45
5.3 มูลค่าการส่งออกข้าวหอมมะลิ ของไทยไปยังประเทศคู่ค้าที่สำคัญ	48
5.4 มูลค่าการส่งออกของข้าวหอมมะลิ 100% ชั้นสอง ของไทยไปยังประเทศคู่ค้าที่สำคัญ	49
6.1 ผลการทดสอบ Seasonal Unit Root Test ที่ระดับ Level	63
6.2 ผลการทดสอบ Seasonal Unit Root Test ที่ระดับ First Difference	64
6.3 ค่าพารามิเตอร์ และค่าสถิติที่ประมาณค่าได้จากแบบจำลอง ARIMA – GARCH กรณีข้อมูลประเทศสหรัฐอเมริกา	66
6.4 ค่าพารามิเตอร์ และค่าสถิติที่ประมาณค่าได้จากแบบจำลอง ARIMA – GARCH กรณีข้อมูลประเทศจีน	68
6.5 ค่าพารามิเตอร์และค่าสถิติที่ประมาณค่าได้จากแบบจำลอง ARIMA – GARCH กรณีข้อมูลประเทศฮ่องกง	70

สารบัญตาราง (ต่อ)

ตาราง	หน้า
7.1 ความยาวของความล่าช้า กรณีข้อมูลประเทศสหรัฐอเมริกา	73
7.2 ค่า AIC SBC และ LR test ทั้ง 5 รูปแบบ ใน Lag Length ที่ 2 กรณีข้อมูลประเทศสหรัฐอเมริกา	73
7.3 ค่า AIC SBC และ LR test ทั้ง 5 รูปแบบ ใน Lag Length ที่ 5 กรณีข้อมูลประเทศสหรัฐอเมริกา	74
7.4 การทดสอบสมมติฐานหาจำนวน Co-integrating Vectors โดยวิธี Trace Test กรณีข้อมูลประเทศสหรัฐอเมริกา	74
7.5 การทดสอบสมมติฐานหาจำนวน Co-integrating Vectors โดยวิธี Max Test กรณีข้อมูลประเทศสหรัฐอเมริกา	75
7.6 ผลการประมาณ Co-integrating Vectors: กรณีข้อมูลประเทศสหรัฐอเมริกา	76
7.7 ความยาวของความล่าช้า กรณีข้อมูลประเทศจีน	82
7.8 ค่า AIC SBC และ LR test ทั้ง 5 รูปแบบ ใน Lag Length ที่ 5 กรณีข้อมูลประเทศจีน	82
7.9 การทดสอบสมมติฐานหาจำนวน Co-integrating Vectors โดยวิธี Trace Test กรณีข้อมูลประเทศจีน	83
7.10 การทดสอบสมมติฐานหาจำนวน Co-integrating Vectors โดยวิธี Max Test กรณีข้อมูลประเทศจีน	83
7.11 ผลการประมาณ Co-integrating Vectors กรณีข้อมูลประเทศจีน	84
7.12 ความยาวของความล่าช้า กรณีข้อมูลประเทศฮ่องกง	90
7.13 ค่า AIC SBC และ LR test ทั้ง 5 รูปแบบ ใน Lag Length ที่ 3 กรณีข้อมูลประเทศฮ่องกง	90
7.14 ค่า AIC SBC และ LR test ทั้ง 5 รูปแบบ ใน Lag Length ที่ 4 กรณีข้อมูลประเทศฮ่องกง	91

สารบัญตาราง (ต่อ)

ตาราง	หน้า
7.15 การทดสอบสมมติฐานหาจำนวน Co-integrating Vectors โดยวิธี Trace Test กรณีข้อมูลประเทศฮ่องกง	91
7.16 การทดสอบสมมติฐานหาจำนวน Co-integrating Vectors โดยวิธี Max Test กรณีข้อมูลประเทศฮ่องกง	92
7.17 ผลการประมาณ Co-integrating Vectors กรณีข้อมูลประเทศฮ่องกง	93

สารบัญภาพ

รูป	หน้า
1.1 ตัดส่วนมูลค่าสินค้าเกษตร 10 อันดับแรก ระหว่างปี 2538 - 2553	2
1.2 การเปลี่ยนแปลงของปริมาณการส่งออกข้าวของประเทศไทย ระหว่างปี 2539 ถึงปี 2553	3
1.3 การเคลื่อนไหวของอัตราแลกเปลี่ยนค่าเงินบาทไทยต่อดอลลาร์สหรัฐ ระหว่างปี 2539 ถึงปี 2553	4
1.4 การเคลื่อนไหวของอัตราแลกเปลี่ยนค่าเงินบาทไทยต่อหยวนจีน และดอลลาร์ฮ่องกง ระหว่างปี 2539 ถึงปี 2553	4
3.1 ผลของการส่งผ่านอัตราแลกเปลี่ยนที่มีต่อการปรับตัวของราคา และปริมาณ	19
5.1 มูลค่าการส่งออกข้าวมวลรวมรายปี ระหว่าง ปี 2541-2553	43