

การส่งผ่านราคาระหว่างตลาดยางพาราของไทย



นาย ธิสิทธิ์ สิมพัฒน์พงศ์

วิทยานิพนธ์นี้เป็นส่วนหนึ่งของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์

คณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

ปีการศึกษา 2548

ISBN 974-14-1841-8

ลิขสิทธิ์ของจุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

๕๑๑๖๐๙๐๕๖

PRICE TRANSMISSION IN THAI RUBBER MARKETS

Mr.Tisit Simapatanapong

A Thesis Submitted in Partial Fulfillment of the Requirements  
for the Degree of Master of Economics Program in Economics

Faculty of Economics  
Chulalongkorn University

Academic Year 2005

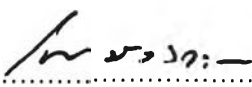
ISBN 974-14-1841-8

481630

หัวข้อวิทยานิพนธ์                      การส่งผ่านราคาระหว่างตลาด  
โดย    นาย ธิสิทธิ์ สีมาพัฒน์พงศ์  
สาขาวิชา                                      เศรษฐศาสตร์  
อาจารย์ที่ปรึกษา                              รองศาสตราจารย์ ดร.พงศา พรชัยวิเศษกุล

---

คณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย อนุมัติให้หัวข้อวิทยานิพนธ์ฉบับนี้เป็นส่วน  
หนึ่งของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญาโทบริหารธุรกิจ

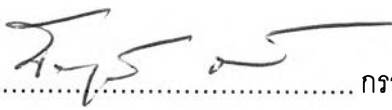
  
..... คณบดีคณะเศรษฐศาสตร์  
(รองศาสตราจารย์ ดร.โสทธิธร มัลลิกะมาส)

คณะกรรมการสอบวิทยานิพนธ์

  
..... ประธานกรรมการ  
(รองศาสตราจารย์ ดร.ไพฑูรย์ ไกรพรรคดี)

  
..... อาจารย์ที่ปรึกษา  
(รองศาสตราจารย์ ดร.พงศา พรชัยวิเศษกุล)

  
..... กรรมการ  
(รองศาสตราจารย์ ดร.อิกรา ศานติศาสตร์)

  
..... กรรมการ  
(ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.ชัยวุฒิ ชัยพันธุ์)

ธิตีธิธิ สิมมาพัฒน์พงศ์ : การส่งผ่านราคากระหว่างตลาดยางพาราของไทย. (Price transmission in Thai Rubber Markets) อ.ที่ปรึกษา: รศ.ดร.พงศา พรชัยวิเศษกุล, 96 หน้า. ISBN 974-14-1841-8.

การศึกษานี้มีวัตถุประสงค์เพื่อศึกษาการส่งผ่านราคากระหว่างตลาดยางพาราเป็นคู่ๆ ได้แก่ การส่งผ่านราคาจากแผ่นจากตลาดส่งออกมายังตลาดท้องถิ่น การส่งผ่านราคาจากแผ่นจากตลาดกลางยางพาราหาคใหญ่มายังตลาดท้องถิ่น และการส่งผ่านราคาน้ำยางชั้นส่งออกมายังราคาน้ำยางสดท้องถิ่น ในการศึกษาจะให้ความสนใจในราคาของตลาดท้องถิ่นเป็นสำคัญอันเป็นราคาที่เกษตรกรทำการซื้อขาย

ในการศึกษาความสัมพันธ์ของราคากระหว่างตลาด ซึ่งใช้ตัวแปรราคาตามกาลเวลารายเดือน ในช่วงปี พ.ศ.2540 ถึง 2548 จำเป็นจะต้องทำการทดสอบคุณสมบัติ Stationary และอันดับของ Integration มิเช่นนั้นอาจจะทำให้เกิดปัญหา Spurious Regression ขึ้นได้ หลังจากทราบอันดับของ Integration ของตัวแปรแล้ว จะทำการทดสอบ Cointegration ระหว่างตัวแปรราคา จากนั้นจึงสร้างสมการความสัมพันธ์ในระยะสั้น ECM และทดสอบการปรับตัวเข้าสู่ดุลยภาพว่ามีความสมมาตรหรือไม่

ผลการศึกษาพบว่าทุกคู่ของราคามีความสัมพันธ์ Cointegration ค่าความยืดหยุ่นในระยะยาวของการส่งผ่านราคาจากแผ่นจากตลาดกลางหาคใหญ่ไปยังตลาดท้องถิ่นมีค่าเท่ากับค่าความยืดหยุ่นในระยะสั้นเท่ากับ 1.06 ค่าที่ได้ใกล้เคียง 1 เป็นเพราะว่าเกษตรกรที่จังหวัดสงขลาจะใช้ราคา ณ ตลาดกลางมาอ้างอิงทำการต่อรองราคากับพ่อค้าคนกลาง ส่วนค่าความยืดหยุ่นในระยะยาวของการส่งผ่านราคาจากตลาดส่งออกไปยังตลาดท้องถิ่นมีค่าเท่ากับ 1.13 สำหรับยางแผ่น และ 1.24 สำหรับน้ำยาง ขณะที่ค่าความยืดหยุ่นในระยะสั้นเท่ากับ 1.28 สำหรับยางแผ่น และ 1.18 สำหรับน้ำยาง ค่าความยืดหยุ่นที่ได้มีค่าเกิน 1 มีสาเหตุมาจากการที่การผลิตยางพารามีความยืดหยุ่นต่ำ สำหรับค่าการปรับตัวในระยะสั้นเพื่อเข้าสู่ดุลยภาพของทุกความสัมพันธ์มีความสมมาตรแม้ว่าในช่วงเวลาที่ทำการศึกษารัฐบาลได้มีนโยบายการแทรกแซงราคาอยู่บ้าง แต่ก็พบว่าปริมาณยางที่รัฐเข้าไปซื้อนั้นมีปริมาณน้อยมากเมื่อเทียบกับปริมาณยางที่ผลิตออกมทั้งหมด จากผลการวิเคราะห์ของวิทยานิพนธ์ฉบับนี้เสนอให้ภาครัฐควรเผยแพร่ข้อมูลข่าวสารทางด้านราคาให้ทั่วถึงแก่เกษตรกร และควรใช้มาตรการรักษาเสถียรภาพของราคากระหว่างเพื่อให้เกษตรกรมีรายได้ที่มั่นคง

สาขาวิชา.....เศรษฐศาสตร์.....

ปีการศึกษา.....2548.....

ลายมือชื่อนิสิต.....ธิตีธิธิ สิมมาพัฒน์พงศ์.....

ลายมือชื่ออาจารย์ที่ปรึกษา.....

# # 4685575229 : MAJOR ECONOMICS

KEY WORD: MARKETING CHANNEL / PRICE TRANSMISSION / ELASTICITY OF PRICE TRANSMISSION

TISIT SIMAPATANAPONG : PRICE TRANSMISSION IN THAI RUBBER MARKETS.

THESIS ADVISOR : ASSOC.PROF.PONGSA PORNCHAIWISESKUL, 96 pp. ISBN 974-14-1841-8.

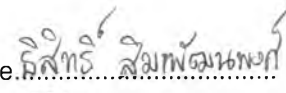
This study aims to examine price transmission in three pairs of rubber markets, namely, price transmission between local and central market of sheet rubber, price transmission between local and export market of sheet rubber and price transmission between local and export market of latex.

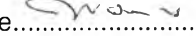
In this study, we use monthly price data between January 1997 and July 2005. For time series data, there may be spurious regression so we first test unit root and order of integration before constructing models. If the prices have the same orders then we estimate Cointegration and ECM to explain long run relationships, short run dynamics and asymmetry.

Results show that a long-run relationship exists in all pairs. Long-run elasticity of price transmission between local and central market is 1.06, nearly 1, because farmers use price of central market in decision to sell their sheet rubber in local market. Long-run elasticity of price transmission between local and export market is 1.13 for sheet rubber and 1.14 for latex. For sheet rubber and latex market, short-run price elasticity between local and export market is 1.28 and 1.18 respectively. The elasticity is more than 1 because elasticity of rubber supply is very low. All speed of adjustment coefficients are symmetry although there is price interfere policy. The quantity of rubber interfered is low comparative to supply of rubber. From the results, this study suggests that government should publicize price and marketing information. Moreover, government should maintain price stability so that farmers will have secure revenue.

Field of study.....Economics.....

Academic year .....2005.....

Student's signature.....

Advisor's signature.....

## กิตติกรรมประกาศ

วิทยานิพนธ์ฉบับนี้สำเร็จลุล่วงด้วยดีได้นั้น ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณ รองศาสตราจารย์ ดร.พงศา พรชัยวิเศษกุล อาจารย์ที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์ รองศาสตราจารย์ ดร.ไพฑูรย์ ไกรพรรคดี ประธานกรรมการ รองศาสตราจารย์ ดร.อิศรา ศานติศาสน์ และผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.ชัยวุฒิ ชัยพันธุ์ กรรมการวิทยานิพนธ์ ซึ่งได้กรุณาสละเวลาถ่ายทอดความรู้ ให้คำปรึกษา และให้ข้อคิดเห็นต่างๆ ที่มีคุณค่าและเป็นประโยชน์ต่อวิทยานิพนธ์ฉบับนี้ ซึ่งผู้เขียนรู้สึกซาบซึ้งในความกรุณาที่ได้รับอย่างยิ่ง ผู้เขียนขอขอบพระคุณ ผศ.ดร.ชัยวุฒิ ชัยพันธุ์ เป็นพิเศษ แม้ว่าท่านมีกิจธุระไปประจำที่ประเทศเยอรมันแต่ท่านก็ได้ช่วยตรวจสอบวิทยานิพนธ์ฉบับนี้ให้ผ่านทางจดหมายอิเล็กทรอนิกส์ ซึ่งท่านเป็นกรรมการสอบที่คอยให้ความเห็นที่ดีเสมอมา แต่เนื่องด้วยความติดขัดทางด้านเอกสารทำให้ไม่สามารถที่จะให้ท่านเซ็นชื่อในดุษฎีนิพนธ์ได้ทันเวลากำหนด ผู้เขียนจึงไม่สามารถใส่ชื่อท่านในรายชื่อกรรมการสอบได้ จึงขออภัยอาจารย์ ณ ที่นี้ด้วย

นอกจากนี้ ผู้เขียนขอขอบพระคุณเจ้าหน้าที่สถาบันวิจัยยางทุกท่านที่ได้ช่วยเหลือในการสืบค้นข้อมูล และให้คำปรึกษาด้านข้อมูลอันเป็นประโยชน์อย่างยิ่ง รวมทั้ง เพื่อนๆ และเจ้าหน้าที่ของหลักสูตรเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย ทุกท่าน ที่ได้ให้ความช่วยเหลือและคอยสอบถามความก้าวหน้าอยู่เสมอ ผู้เขียนขอขอบคุณความสำเร็จของวิทยานิพนธ์ฉบับนี้แต่บิดา และมารดาของข้าพเจ้าที่นอกจากจะให้กำลังใจและแรงกระตุ้นแล้วยังให้ข้อมูล และคำแนะนำที่เกี่ยวข้องกับวิทยานิพนธ์ฉบับนี้จนสำเร็จลุล่วงไปด้วยดี

## สารบัญ

	หน้า
บทคัดย่อภาษาไทย.....	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ.....	จ
กิตติกรรมประกาศ.....	ฉ
สารบัญ.....	ช
สารบัญตาราง.....	ฅ
สารบัญแผนภาพ.....	ฎ
<b>บทที่ 1 บทนำ</b>	
1.1 ความเป็นมาและความสำคัญของปัญหา.....	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการวิจัย.....	4
1.3 ขอบเขตของการวิจัย.....	4
1.4 แหล่งที่มาของข้อมูล.....	5
1.5 คำจำกัดความที่ใช้ในการวิจัย.....	5
1.6 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ.....	6
<b>บทที่ 2 เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง</b>	
2.1 แนวคิดและทฤษฎี.....	7
2.1.1 ทฤษฎีทางเศรษฐมิติ.....	7
2.1.2 ทฤษฎีการตลาด.....	14
2.2 เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง.....	17
2.2.1 งานวิจัยที่เกี่ยวกับยางพารา.....	17
2.2.2 งานวิจัยเกี่ยวกับการส่งผ่านราคาสินค้า.....	19
<b>บทที่ 3 วิธีดำเนินการวิจัย</b>	
3.1 การทดสอบ Unit root.....	25
3.2 การหา Cointegration and Vector Error Correction Model (VECM) ด้วยวิธีของ Johansen.....	27
3.3 Cointegration and Asymmetric Error Correction Model เมื่อมี ตัวแปรภายในตัวเดียว.....	30
<b>บทที่ 4 ธุรกิจยางพาราของประเทศไทย</b>	
4.1 การผลิตและต้นทุน.....	34
4.1.1 พื้นที่ปลูกยางในประเทศไทย.....	34

	๗
	หน้า
4.1.2 ต้นทุนการผลิตยางของเกษตรกร.....	37
4.2 ระบบตลาดยางในประเทศไทย.....	43
4.2.1 ตลาดยางในประเทศไทย.....	44
4.2.2 วิธีการตลาดยางพารา.....	46
4.2.3 การกำหนดราคาซื้อขายจากเกษตรกร.....	50
4.3 การค้ายางพาราในตลาดโลก.....	51
4.3.1 การผลิต.....	51
4.3.2 การบริโภค.....	53
4.3.3 การค้า.....	54
<b>บทที่ 5 ผลการวิเคราะห์ข้อมูล</b>	
5.1 การทดสอบคุณสมบัติ Stationary.....	60
5.2 การทดสอบ Cointegration และ Asymmetric ECM.....	77
5.2.1 การทดสอบ Cointegration ของราคาทั้งสามตัวด้วยวิธีของ Johansen.....	77
5.2.2 การทดสอบ Cointegration ของราคาเป็นคู่ๆ.....	78
5.3 การส่งผ่านราคายางจากตลาดกลางไปยังตลาดท้องถิ่นและการปรับตัว เข้าสู่ดุลยภาพ.....	81
5.4 การส่งผ่านราคายางจากตลาดส่งออก F.O.B. ไปยังตลาดท้องถิ่นและ การปรับตัวเข้าสู่ดุลยภาพ.....	82
5.5 เปรียบเทียบผลการส่งผ่านราคา .....	83
<b>บทที่ 6 สรุปผลการวิจัย อภิปรายผล และข้อเสนอแนะ</b>	
6.1 สรุปผลการวิจัย.....	86
6.2 อภิปรายผลการวิจัย.....	88
6.3 ข้อเสนอแนะทางด้านนโยบาย.....	89
6.4 ข้อจำกัดในการศึกษาและข้อเสนอแนะในการศึกษาครั้งต่อไป.....	91
รายการอ้างอิง.....	92
ประวัติผู้เขียนวิทยานิพนธ์.....	96



## สารบัญตาราง

๗

ตาราง	หน้า
3.1 ค่าสถิติการกระจายของ $\phi$ .....	32
3.2 ค่าสถิติการกระจายของ t-max.....	32
4.1 พื้นที่ปลูกยางพาราและพื้นที่กรี๊ดได้ของไทย ปี 2546.....	34
4.2 พื้นที่ปลูกยางของไทยตั้งแต่อดีต.....	36
4.3 อัตราการแบ่งผลผลิตเป็นค่าจ้างกรี๊ด.....	40
4.4 ผลผลิตยางเฉลี่ยในแต่ละช่วงปีกรี๊ด.....	41
4.5 สรุปต้นทุนการผลิตยางแผ่นดิบของสวนยางขนาดเล็ก.....	42
4.6 ปริมาณยางที่ซื้อขายผ่านตลาดกลางยางพาราทั้ง 3 ตลาด.....	45
4.7 เปรียบเทียบราคายางแผ่นดิบตลาดกลางยางพาราและตลาดท้องถิ่น.....	46
4.8 การกำหนดราคารับซื้อยางแผ่นดิบจากเกษตรกร.....	51
4.9 ปริมาณการผลิตยางธรรมชาติของโลก.....	52
4.10 ปริมาณการบริโภคยางธรรมชาติของโลก.....	53
4.11 สัดส่วนของยางธรรมชาติในโครงสร้างล้อรถยนต์ประเภทต่างๆ.....	54
4.12 การส่งออกยางพาราของประเทศผู้ผลิต.....	57
4.13 การนำเข้ายางธรรมชาติสุทธิของประเทศผู้นำเข้า.....	58
4.14 การนำเข้าน้ำยางข้นของประเทศผู้นำเข้าหลัก.....	59
5.1 ค่าสถิติ Dickey-Fuller Tests.....	69
5.2 การทดสอบ Unit root ของราคายาง.....	69
5.3 ผลสรุปจากการทดสอบ Unit root.....	76
5.4 สมการความสัมพันธ์ในระยะยาว.....	79
5.5 ค่าสัมประสิทธิ์ที่ใช้ทดสอบ Cointegration แบบไม่สมมาตร.....	79
5.6 การทดสอบ Cointegration แบบสมมาตร ตามวิธีของ Engle Granger.....	80

ตาราง

หน้า

5.7 สมการการปรับตัวในระยะสั้น.....

81

## สารบัญแผนภาพ

ฉ

แผนภาพ	หน้า
1.1 การผลิต การใช้ และสต็อกยางพาราของโลก.....	2
1.2 ปริมาณการผลิตยางธรรมชาติของโลก.....	3
2.1 อุปสงค์และอุปทานสีบเนื่อง.....	14
2.2 การแปลงอุปทานระดับไร่นาไปเป็นอุปทานระดับชายปลึก.....	16
4.1 วิธีกรตลตดยงม่น .....	48
4.2 วิธีกรตลตดน้ำยงชั้น.....	49
5.1 กรรฟแสดงค้ log ของรคยงม่นของท้ 3 ตลตด.....	62
5.2 กรรฟแสดงค้ log ของรคาน้ำยงน 2 ตลตด.....	63
5.3 กรรฟแสดง First difference ของรคยงม่น.....	64
5.4 กรรฟแสดง First difference ของรคาน้ำยง.....	67