

สารบัญ

	หน้า
สารบัญตาราง	(3)
สารบัญภาพ	(9)
บทที่ 1 บทนำ	1
ความสำคัญของปัญหา	1
วัตถุประสงค์ของการศึกษา	4
ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ	5
ขอบเขตของการศึกษา	5
สมมติฐานในการศึกษา	6
วิธีการศึกษา	6
การเก็บรวบรวมข้อมูล	6
การวิเคราะห์ข้อมูล	6
บทที่ 2 โครงร่างทางทฤษฎีและการตรวจเอกสาร	8
การตรวจเอกสาร	8
แนวคิดทางทฤษฎี	17
แนวคิดทฤษฎีอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริง	17
คุณภาพของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตรา	19
แบบจำลองที่ใช้การศึกษา	22
บทที่ 3 ระบบอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศไทยตั้งแต่พ.ศ.2488 ถึง พ.ศ.2548และความสัมพันธ์ทางการค้าสินค้าเกษตรที่สำคัญระหว่างประเทศไทยกับประเทศสหรัฐอเมริกา	29
ระบบอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศไทยตั้งแต่พ.ศ.2488 ถึง พ.ศ.2548	29
ความสัมพันธ์ทางการค้าสินค้าเกษตรที่สำคัญระหว่างประเทศไทยกับประเทศสหรัฐอเมริกา	31
ข้าว	31
ยางพารา	34

สารบัญ (ต่อ)

	หน้า
กึ่งแซ่เย็นแซ่แข็ง	37
บทที่ 4 การวิเคราะห์	42
ผลการทดสอบแบบจำลองที่ 1 ผลกระทบของอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริง ที่มีต่อราคาส่งออกข้าวของไทยที่ส่งออกไปสหรัฐอเมริกา	42
ผลการทดสอบแบบจำลองที่ 2 ผลกระทบของอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริง ที่มีต่อราคาส่งออกยางพาราของไทยที่ส่งออกไปสหรัฐอเมริกา	47
ผลการทดสอบแบบจำลองที่ 3 ผลกระทบของอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริง ที่มีต่อราคาส่งออกกึ่งแซ่เย็นแซ่แข็งของไทยที่ส่งออกไปสหรัฐอเมริกา	53
บทที่ 5 สรุปและข้อเสนอแนะ	59
สรุป	59
ข้อจำกัดและข้อเสนอแนะ	62
เอกสารและสิ่งอ้างอิง	64
ภาคผนวก	67

สารบัญตาราง

ตารางที่		หน้า
1	มูลค่าสินค้าเกษตรส่งออกที่สำคัญ พ.ศ.2540-พ.ศ.2546	2
2	ปริมาณและมูลค่าการส่งออกข้าวจากประเทศไทยไปยังประเทศสหรัฐอเมริกา พ.ศ.2540-พ.ศ.2547	32
3	ปริมาณการส่งออกยางพาราของประเทศผู้ผลิตที่สำคัญ พ.ศ. 2530-2541	35
4	ปริมาณและมูลค่าการส่งออกยางพาราจากประเทศไทยไปยังประเทศสหรัฐอเมริกา พ.ศ. 2540-2547	36
5	ปริมาณกึ่งที่ได้จากการเพาะเลี้ยง จากการจับได้ในทะเล และปริมาณผลผลิตกึ่งทั้งหมด	37
6	ปริมาณและมูลค่าการส่งออกกึ่งแช่เย็นแช่แข็ง จำแนกเป็นรายประเทศ พ.ศ. 2545-2546	38
7	ปริมาณและมูลค่าการส่งออกกึ่งแช่เย็นแช่แข็งจากประเทศไทยไปยังประเทศสหรัฐอเมริกา พ.ศ. 2540-2547	39
8	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ของข้อมูลด้วย unit root ที่ค่าระดับของข้อมูล (at level) ของข้าว	43
9	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ของข้อมูลด้วย unit root ที่ค่าระดับของข้อมูลอยู่ในรูปผลต่างครั้งที่ 1 (At First defferentiate) ของข้าว	44
10	ผลการทดสอบ Cointegration ระหว่างราคาส่งออกข้าวกับ ราคาข้าวในตลาดโลก อัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงข้าว และต้นทุนการผลิตข้าว	45

สารบัญตาราง (ต่อ)

ตารางที่		หน้า
11	ผลการประมาณค่าแบบจำลองที่ 1 ข้าว	45
12	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ของข้อมูลด้วย unit root ที่ค่าระดับของข้อมูล (at level) ของยางพารา	48
13	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ของข้อมูลด้วย unit root ที่ค่าระดับของข้อมูลอยู่ในรูปผลต่างครั้งที่ 1 (At First defferentiate) ของยางพารา	49
14	ผลการทดสอบ Cointegration ระหว่างราคาส่งออกยางพารากับ ราคายางพาราในตลาดโลก อัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงยางพารา และต้นทุนการผลิตยางพารา	50
15	ผลการประมาณค่าแบบจำลองที่ 2 ยางพารา	51
16	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ของข้อมูลด้วย unit root ที่ค่าระดับของข้อมูล (at level) ของกุ้งแช่เย็นแช่แข็ง	53
17	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ของข้อมูลด้วย unit root ที่ค่าระดับของข้อมูลอยู่ในรูปผลต่างครั้งที่ 1 (At First defferentiate) ของกุ้งแช่เย็นแช่แข็ง	54
18	ผลการทดสอบ Cointegration ระหว่างราคาส่งออกกุ้งแช่เย็นแช่แข็งกับราคากุ้งแช่เย็นแช่แข็งในตลาดโลก อัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงกุ้งแช่เย็นแช่แข็ง และต้นทุนการผลิตกุ้งแช่เย็นแช่แข็ง	55
19	ผลการประมาณค่าแบบจำลองที่ 3 กุ้งแช่เย็นแช่แข็ง	56

สารบัญตาราง (ต่อ)

ตารางผนวกที่		หน้า
1	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ level ของราคาส่งออกข้าว (px1)	68
2	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ level ของราคาส่งออกข้าว ในตลาดโลก (pw1)	69
3	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ level ของอัตราแลกเปลี่ยนที่ แท้จริงข้าว (rer1)	70
4	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ level ของต้นทุนการผลิตข้าว (cp1)	71
5	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ level ของราคาส่งออกยางพารา (px2)	72
6	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ level ของราคาส่งออกยางพารา ในตลาดโลก (pw2)	73
7	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ level ของอัตราแลกเปลี่ยนที่ แท้จริงยางพารา (rer2)	74
8	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ level ของต้นทุนการผลิตยาง พารา (cp2)	75
9	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ level ของราคาส่งออกกุ้งแช่เย็น แช่แข็ง (px3)	76
10	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ level ของราคาส่งออกกุ้งแช่เย็น แช่แข็งในตลาดโลก (pw3)	77

สารบัญตาราง (ต่อ)

ตารางผนวกที่		หน้า
11	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ level ของอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงกึ่งแข็ง (rer3)	78
12	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ level ของต้นทุนการผลิตกึ่งแข็ง (cp3)	79
13	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ First Difference ของราคาส่งออกข้าว (px1)	80
14	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ First Difference ของราคาข้าวในตลาดโลก (pw1)	81
15	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ First Difference ของอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงข้าว (rer1)	82
16	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ First Difference ของต้นทุนการผลิตข้าว (cp1)	83
17	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ First Difference ของราคาส่งออกยางพารา (px2)	85
18	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ First Difference ของราคายางพาราในตลาดโลก (pw2)	86
19	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ First Difference ของอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงยางพารา (rer2)	87

สารบัญตาราง (ต่อ)

ตารางผนวกที่		หน้า
20	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ First Difference ของต้นทุนการผลิตยางพารา (cp2)	88
21	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ First Difference ของราคาส่งออกกุ้งแช่เย็นแช่แข็ง (px3)	89
22	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ First Difference ของราคากุ้งแช่เย็นแช่แข็งในตลาดโลก (pw3)	90
23	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ First Difference ของอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงกุ้งแช่เย็นแช่แข็ง (rer3)	91
24	ผลการทดสอบลักษณะ Stationary ณ ระดับ First Difference ของต้นทุนการผลิตกุ้งแช่เย็นแช่แข็ง (cp3)	92
25	ผลการทดสอบคุณสมบัติ Cointegration ระหว่างราคาส่งออกข้าว (px1) กับ ราคาข้าวในตลาดโลก (pw1)	93
26	ผลการทดสอบคุณสมบัติ Cointegration ระหว่างราคาส่งออกข้าว (px1) กับ อัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงข้าว (rer1)	95
27	ผลการทดสอบคุณสมบัติ Cointegration ระหว่างราคาส่งออกข้าว (px1) กับ ต้นทุนการผลิตข้าว (cp1)	97
28	ผลการทดสอบคุณสมบัติ Cointegration ระหว่างราคาส่งออกยางพารา (px2) กับ ราคายางพาราในตลาดโลก (pw2)	99

สารบัญตาราง (ต่อ)

ตารางผนวกที่		หน้า
29	ผลการทดสอบคุณสมบัติ Cointegration ระหว่างราคาส่งออกยางพารา (px2) กับ อัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงยางพารา (rer2)	101
30	ผลการทดสอบคุณสมบัติ Cointegration ระหว่างราคาส่งออกยางพารา (px2) กับ ต้นทุนการผลิตยางพารา (cp2)	103
31	ผลการทดสอบคุณสมบัติ Cointegration ระหว่างราคาส่งออกกุ้งแช่เย็นแช่แข็ง (px3) กับ ราคากุ้งแช่เย็นแช่แข็งในตลาดโลก (pw3)	105
32	ผลการทดสอบคุณสมบัติ Cointegration ระหว่างราคาส่งออกกุ้งแช่เย็นแช่แข็ง (px3) กับ อัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงกุ้งแช่เย็นแช่แข็ง (rer3)	107
33	ผลการทดสอบคุณสมบัติ Cointegration ระหว่างราคาส่งออกกุ้งแช่เย็นแช่แข็ง (px3) กับ ต้นทุนการผลิตกุ้งแช่เย็นแช่แข็ง (cp3)	109
34	ผลการประมาณสมการตามแบบจำลองที่ 1 ข้าว	111
35	ผลการประมาณสมการตามแบบจำลองที่ 2 ยางพารา	112
36	ผลการประมาณสมการตามแบบจำลองที่ 3 กุ้งแช่เย็นแช่แข็ง	113
37	ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษาแบบจำลองที่ 1 ข้าว	114
38	ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษาแบบจำลองที่ 2 ยางพารา	119
39	ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษาแบบจำลองที่ 3 กุ้งแช่เย็นแช่แข็ง	124

สารบัญภาพ

ภาพที่		หน้า
1	มูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรกรรมไปต่างประเทศที่สำคัญ พ.ศ. 2546	3
2	วิธีประมาณค่าความยืดหยุ่นสำหรับดุลยภาพอัตราแลกเปลี่ยน	20