

บทที่ 1

บทนำ

ความสำคัญของปัญหา

ประเทศไทยเป็นประเทศที่กำลังพัฒนาและเป็นประเทศที่เน้นเกษตรกรรมเป็นหลัก คือ ประชากรในประเทศส่วนใหญ่ประกอบอาชีพเกษตรกรรม ภาคเกษตรจึงเป็นฐานการผลิตที่สำคัญของประเทศไทย โดยมีการผลิตเพื่อบริโภคภายในประเทศและส่งออกไปยังต่างประเทศ ซึ่งนำมาสู่รายได้ของประเทศไทย ในปัจจุบันสินค้าเกษตรส่งออกที่สำคัญของไทยมีมากมายได้แก่ ยางพาราและผลิตภัณฑ์ ข้าวและผลิตภัณฑ์ กุ้งสดและผลิตภัณฑ์ ปลาและผลิตภัณฑ์ ไม้และผลิตภัณฑ์ น้ำตาลและผลิตภัณฑ์ ผลไม้และผลิตภัณฑ์ กระจาดและผลิตภัณฑ์ มันสำปะหลังและผลิตภัณฑ์ และเนื้อไก่ (ตารางที่ 1)

ประเทศที่นำเข้าสินค้าเกษตรของประเทศไทยมีมากมายหลายประเทศ เช่น ญี่ปุ่น สหรัฐอเมริกา ฮองกง จีน และประเทศอื่นๆ โดยแต่ละประเทศมีส่วนการนำเข้าสินค้าเกษตรแต่ละชนิดแตกต่างกันไปตามความต้องการของประเทศนั้นๆ ซึ่งประเทศที่ไทยส่งออกสินค้าเกษตรไปเป็นจำนวนมาก คือ ญี่ปุ่น กับ สหรัฐอเมริกา ซึ่งมีสัดส่วนการส่งออกไปญี่ปุ่นและสหรัฐอเมริกาเท่ากับ 18 เปอร์เซ็นต์ และ 17 เปอร์เซ็นต์ ตามลำดับ (ภาพที่ 1)

การค้าระหว่างประเทศเป็นปัจจัยหนึ่งซึ่งช่วยผลักดันให้เศรษฐกิจเจริญเติบโต การค้าระหว่างประเทศหรือการติดต่อธุรกรรมระหว่างประเทศ จำเป็นต้องอาศัยอัตราแลกเปลี่ยนซึ่งจะทำหน้าที่เชื่อมโยงระหว่างราคาสินค้าของประเทศต่างๆ ซึ่งตามทฤษฎีได้กล่าวไว้ว่า เมื่ออัตราแลกเปลี่ยนเปลี่ยนแปลงไปจะส่งผลกระทบต่อการนำเข้าและการส่งออก คือ ถ้าอัตราแลกเปลี่ยนลดลงจะทำให้การนำเข้าเพิ่มขึ้นและการส่งออกลดลง ในทางตรงกันข้าม ถ้าอัตราแลกเปลี่ยนเพิ่มขึ้น จะทำให้การนำเข้าลดลงและการส่งออกเพิ่มขึ้น

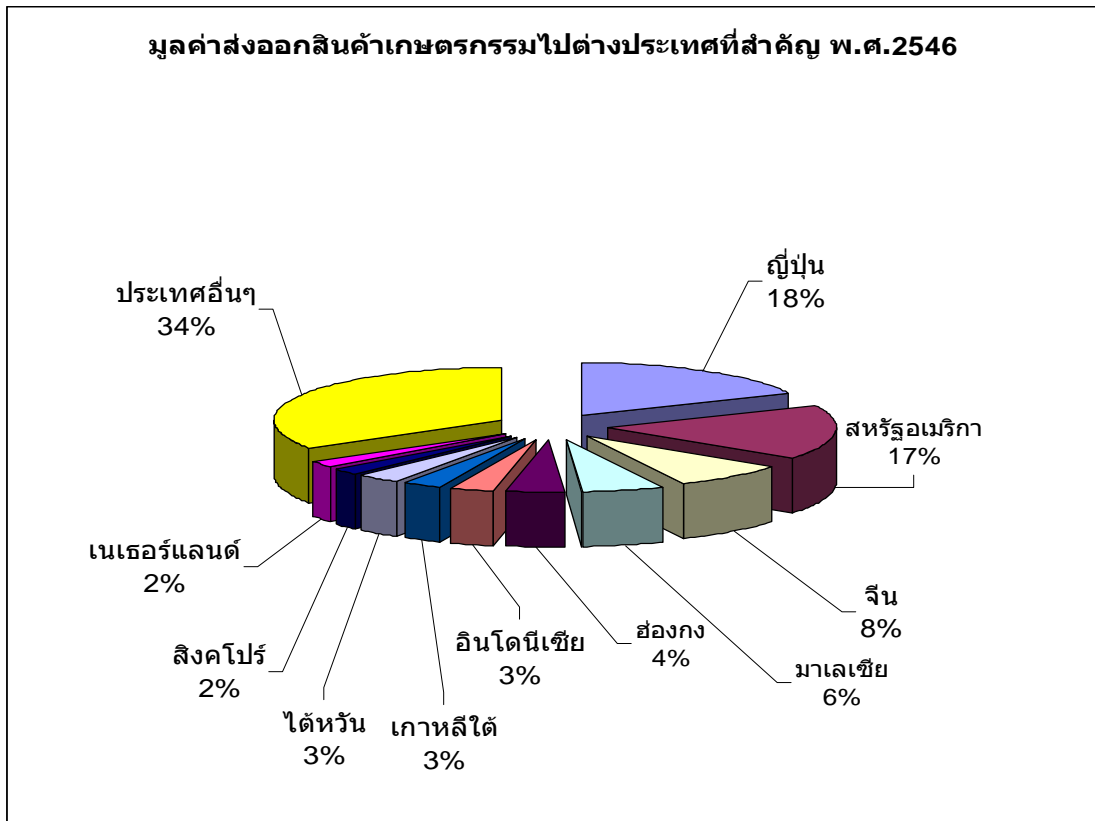
หลังจากที่ประเทศไทยได้ประกาศลอยตัวของค่าเงิน ในวันที่ 2 กรกฎาคม พ.ศ.2540 มีผลทำให้อัตราแลกเปลี่ยนเปลี่ยนแปลงไปจากเดิม ซึ่งจะส่งผลกระทบต่อราคาสินค้าส่งออกและนำเข้าของประเทศไทยให้มีการเปลี่ยนแปลงไปด้วย โดยเฉพาะอย่างยิ่งจะส่งผลกระทบต่อราคาสินค้าเกษตรส่งออกที่สำคัญของไทย

ตารางที่ 1 มูลค่าสินค้าเกษตรส่งออกที่สำคัญ พ.ศ.2540-พ.ศ.2546

(หน่วย: ล้านบาท)

รายการ	2540	2541	2542	2543	2544	2545	2546
มูลค่าสินค้าส่งออกทั้งหมด	1,800,832	2,242,543	2,209,458	2,764,352	2,880,463	2,917,709	33,330,006
มูลค่าสินค้าเกษตรและผลิตภัณฑ์	484,847	591,062	555,783	626,286	685,148	694,403	804,189
สินค้าเกษตรส่งออกที่สำคัญ 10 อันดับแรก							
1.ยางพาราและผลิตภัณฑ์	82,644	91,642	77,871	150,004	109,483	131,630	184,579
2.ข้าวและผลิตภัณฑ์	67,583	89,440	78,116	70,419	75,368	75,728	82,391
3.กุ้งและผลิตภัณฑ์	75,714	95,841	87,610	107,932	98,723	73,974	71,871
4.ปลาและผลิตภัณฑ์	40,286	51,530	48,221	45,266	56,752	58,265	65,224
5.ไม้และผลิตภัณฑ์	20,963	28,443	33,908	42,777	44,393	49,820	51,168
6.น้ำตาลและผลิตภัณฑ์	34,362	29,394	23,178	29,333	35,453	34,434	43,519
7.ผลไม้และผลิตภัณฑ์	21,808	20,003	28,625	26,451	28,409	31,738	36,565
8.กระดาษและผลิตภัณฑ์	11,099	20,526	25,183	30,697	32,541	29,986	35,007
9.มันสำปะหลังและผลิตภัณฑ์	22,537	22,225	23,069	20,387	25,727	22,878	27,224
10.เนื้อไก่	10,951	16,639	15,262	15,689	23,936	22,959	24,787
สินค้าเกษตรกรรมอื่นๆ	93,451	125,379	114,740	132,331	154,363	162,991	181,854

ที่มา: สำนักงานเศรษฐกิจการเกษตร (2546)



ภาพที่ 1 มูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรกรรมไปต่างประเทศที่สำคัญ พ.ศ.2546

ที่มา: สำนักงานเศรษฐกิจการเกษตร (2546)

การวิเคราะห์ค่าเงินควรพิจารณาจากอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริง (Real Exchange Rate) เพื่อชี้ให้เห็นทิศทางการเคลื่อนไหวของค่าเงินที่แท้จริง เช่น ประเทศที่มีระดับราคาสินค้าสูงขึ้นเรื่อยๆ (ภาวะเงินเฟ้อ) อัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงจะลดลง ในขณะที่อัตราแลกเปลี่ยนในนาม (Nominal Exchange Rate) อาจไม่เปลี่ยนแปลงเลยก็ได้ หากไม่มีการปรับเปลี่ยนให้สอดคล้องกับความเป็นจริงอัตราแลกเปลี่ยนที่ใช้อาจบิดเบือนค่าที่ควรจะเป็นของเงินตราในประเทศ ก่อให้เกิดปัญหาและอุปสรรคต่อการส่งออก ดังนั้นการหาอัตราแลกเปลี่ยนให้อยู่ในรูปที่แท้จริงจึงเป็นสิ่งจำเป็น ซึ่งจะช่วยให้สามารถรักษาความได้เปรียบในเชิงแข่งขันทางการค้ากับต่างประเทศได้

งานศึกษาในประเทศไทยที่ผ่านมาที่ศึกษาเกี่ยวกับผลของการเปลี่ยนแปลงอัตราแลกเปลี่ยนส่วนมากจะมุ่งประเด็นไปที่มูลค่าและปริมาณการส่งออก โดยกล่าวว่าเมื่ออัตราแลกเปลี่ยนเพิ่มขึ้นทำให้มูลค่าและปริมาณการส่งออกเพิ่มขึ้น เนื่องจากราคาสินค้าส่งออกลดลง แต่ผลของอัตราแลกเปลี่ยนที่มีต่อราคาส่งออกสินค้าอาจไม่ได้เป็นดังที่กล่าวไว้เสมอไป เนื่องจากผลกระทบของ

อัตราแลกเปลี่ยนที่มีต่อราคาสินค้าส่งออก สามารถแบ่งออกได้เป็น 3 กรณี ได้แก่ กรณีแรก ได้รับผลจากอัตราแลกเปลี่ยนแบบสมบูรณ์ (Complete Pass-Through) คือ ผู้ส่งออกเลือกที่จะรับผลจากการเปลี่ยนแปลงในอัตราแลกเปลี่ยนโดยให้ราคาสินค้าที่ขายในสกุลเงินบาทคงที่ ซึ่งจะทำให้ราคาสินค้าส่งออกในสกุลเงินต่างประเทศมีราคาตกลงหรือเพิ่มขึ้นเท่ากับการเปลี่ยนแปลงในอัตราแลกเปลี่ยน กรณีสอง ได้รับผลจากอัตราแลกเปลี่ยนแบบไม่สมบูรณ์ (Incomplete Pass-Through) คือ ผู้ส่งออกเลือกที่จะรับผลของการเปลี่ยนแปลงในอัตราแลกเปลี่ยนไว้บางส่วนและส่งผลบางส่วนไปยังราคาขายในต่างประเทศ กรณีสาม ไม่ได้รับผลจากอัตราแลกเปลี่ยน (No Pass-Through) คือ เมื่ออัตราแลกเปลี่ยนเปลี่ยนแปลงไป ผู้ส่งออกเลือกที่จะเปลี่ยนแปลงราคาขายในสกุลเงินบาทไปตามอัตราแลกเปลี่ยน ซึ่งทำให้ราคาสินค้าที่ขายในสกุลเงินต่างประเทศไม่มีการเปลี่ยนแปลง ดังนั้นจึงมีความน่าสนใจที่จะทำการศึกษาถึงผลกระทบของอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงที่มีต่อราคาส่งออกข้าว ยางพารา และกุ้งแช่เย็นแช่แข็ง ของไทยที่ส่งออกไปสหรัฐอเมริกาว่ามีผลกระทบอย่างไร

วัตถุประสงค์ของการศึกษา

1. เพื่อศึกษาระบบอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศไทยตั้งแต่พ.ศ.2488 ถึง พ.ศ.2548 และศึกษาความสัมพันธ์ทางการค้าสินค้าเกษตรระหว่างประเทศไทยกับประเทศสหรัฐอเมริกา
2. เพื่อศึกษาผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงที่มีต่อราคาส่งออกข้าว ยางพารา และกุ้งแช่เย็นแช่แข็ง ของไทยที่ส่งออกไปสหรัฐอเมริกา

ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ

1. ทำให้ทราบถึงระบบอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศไทยตั้งแต่พ.ศ.2488 ถึง พ.ศ.2548 และความสัมพันธ์ทางการค้าสินค้าเกษตรระหว่างประเทศไทยกับประเทศสหรัฐอเมริกา
2. ทำให้ทราบถึงผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงที่มีต่อราคาส่งออกข้าว ยางพารา และกุ้งแช่เย็นแช่แข็ง ของไทยที่ส่งออกไปสหรัฐอเมริกา ว่าราคาส่งออกสินค้าชนิดใดได้รับผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงอัตราแลกเปลี่ยนมากน้อยเพียงใด เพื่อเป็นแนวทางสำหรับผู้มีหน้าที่เกี่ยวข้องในการวางแผนกลยุทธ์ในการส่งเสริมภาคการส่งออก และเป็นข้อเสนอแนะส่วนหนึ่งสำหรับภาครัฐบาลในการกำหนดทิศทางการเงินที่เกี่ยวข้องกับอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อแก้ปัญหาดุลการค้าให้มีประสิทธิภาพมากขึ้น

ขอบเขตการศึกษา

ในการศึกษาผลกระทบของการเปลี่ยนแปลงอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงที่มีต่อราคาส่งออกข้าว ยางพารา และกุ้งแช่เย็นแช่แข็ง ของไทยที่ส่งออกไปสหรัฐอเมริกา โดยจะทำการเลือกศึกษาสินค้าเกษตรส่งออกที่สำคัญ ได้แก่ ข้าว ยางพารา กุ้งแช่เย็นแช่แข็ง โดยการศึกษานี้จะใช้ข้อมูลรายเดือนตั้งแต่เดือนมกราคม พ.ศ.2541- เดือนธันวาคม พ.ศ.2548

สมมติฐานการศึกษา

1. ราคาสินค้าส่งออกมีความสัมพันธ์เชิงดูลยภาพระยะยาวกับราคาสินค้าในตลาดโลกในทิศทางเดียวกัน กล่าวคือ ถ้าราคาสินค้าในตลาดโลกเพิ่มขึ้น จะส่งผลให้ราคาสินค้าส่งออกเพิ่มขึ้น ในทางตรงกันข้าม ถ้าราคาสินค้าในตลาดโลกลดลง จะส่งผลให้ราคาสินค้าส่งออกลดลง
2. ราคาสินค้าส่งออกมีความสัมพันธ์เชิงดูลยภาพระยะยาวกับอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงในทิศทางตรงกันข้าม กล่าวคือ ถ้าอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงเพิ่มขึ้น (ค่าเงินบาทลดลง) จะส่งผลให้ราคาสินค้าส่งออกลดลง ในทางตรงกันข้าม ถ้าอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงลดลง (ค่าเงินบาทเพิ่มขึ้น) จะส่งผลให้ราคาสินค้าส่งออกเพิ่มขึ้น
3. ราคาสินค้าส่งออกมีความสัมพันธ์เชิงดูลยภาพระยะยาวกับต้นทุนการผลิตในทิศทางเดียวกัน กล่าวคือ ถ้าต้นทุนการผลิตเพิ่มขึ้น จะส่งผลให้ราคาส่งออกเพิ่มขึ้น ในทางตรงกันข้าม ถ้าต้นทุนการผลิตลดลง จะส่งผลให้ราคาสินค้าส่งออกลดลง

วิธีการศึกษา

การเก็บรวบรวมข้อมูล

ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษาเป็นข้อมูลทุติยภูมิรายเดือนตั้งแต่เดือนมกราคม พ.ศ.254 ถึงเดือนธันวาคม พ.ศ.2548 โดยข้อมูลเก็บจากหน่วยงานต่างๆ คือ ธนาคารแห่งประเทศไทย กรมศุลกากร กรมส่งเสริมการเกษตร กรมส่งเสริมการส่งออก และห้องสมุดของมหาวิทยาลัยต่างๆ

การวิเคราะห์ข้อมูล

1. การวิเคราะห์ในเชิงพรรณนา (Descriptive analysis)

ศึกษาระบบอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศไทยตั้งแต่ พ.ศ.2488 ถึง พ.ศ.2548 และศึกษาความสัมพันธ์ทางการค้าสินค้าเกษตรระหว่างประเทศไทยกับประเทศสหรัฐอเมริกา

2. การวิเคราะห์ในเชิงปริมาณ (Quantitative analysis)

การศึกษาผลกระทบของการเปลี่ยนแปลงอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงที่มีต่อราคาส่งออกข้าว ยางพารา และกุ้งแช่เย็นแช่แข็ง ของไทยที่ส่งออกไปสหรัฐอเมริกา ซึ่งการวิเคราะห์ในเชิงปริมาณแบ่งออกเป็น 2 ขั้นตอนคือ

ขั้นตอนที่ 1 คำนวณหาอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริง

ขั้นตอนที่ 2 ทดสอบหาความสัมพันธ์ระหว่างการเปลี่ยนแปลงอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงกับราคาส่งออกข้าว ยางพารา และกุ้งแช่เย็นแช่แข็ง ของไทยที่ส่งออกไปสหรัฐอเมริกา ซึ่งข้อมูลที่ใช้ทำการวิเคราะห์ต้องมีคุณสมบัติ Stationary เพื่อให้ผลการวิเคราะห์ทางสถิติมีประสิทธิภาพและมีความน่าเชื่อถือมากขึ้น การตรวจสอบคุณสมบัติ Stationary ของข้อมูลจะทำการทดสอบ Unit Root ที่เสนอโดย Dicky and Fuller จากนั้นจึงนำข้อมูลที่มีคุณสมบัติ Stationary มาทำการวิเคราะห์ Cointegration ทดสอบหาความสัมพันธ์ระยะยาว และทำการประมาณค่าสมการตามแบบจำลอง เพื่อหาทิศทางและขนาดโดยใช้วิธีกำลังสองน้อยที่สุด หลังจากนั้นทำการประมาณหาค่าความยืดหยุ่นของการส่งออกของการเปลี่ยนแปลงอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงต่อราคาส่งออกข้าว ยางพารา และกุ้งแช่เย็นแช่แข็ง