

ห้องสมุดงานวิจัย สำนักงานคณะกรรมการวิจัยแห่งชาติ



249567



ราคาข้าวขาว 5% ในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย

พระชนด อุปแก้ว

วิทยานิพนธ์เสนอต่อมหาวิทยาลัยรามคำแหง  
เป็นส่วนหนึ่งของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต  
ปีการศึกษา 2553

600253984

ห้องสมุดงานวิจัย สำนักงานคณะกรรมการวิจัยแห่งชาติ



249567

ราคาข้าวขาว 5% ในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย



พรรัชชล อุปแก้ว

วิทยานิพนธ์เสนอต่อมหาวิทยาลัยรามคำแหง  
เป็นส่วนหนึ่งของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต  
ปีการศึกษา 2553  
ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยรามคำแหง

THE PRICE OF FIVE PERCENT WHITE RICE ON THE  
AGRICULTURAL FUTURES EXCHANGE  
OF THAILAND

PATSACHOL OUPKAEW

A THESIS PRESENTED TO RAMKHAMHAENG UNIVERSITY  
IN PARTIAL FULFILLMENT OF THE REQUIREMENTS  
FOR THE DEGREE OF MASTER OF ECONOMICS

2010

COPYRIGHTED BY RAMKHAMHAENG UNIVERSITY

ชื่อเรื่องวิทยานิพนธ์ ราคาข้าวขาว 5% ในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย

ชื่อผู้เขียน นางสาวพรรัชชล อุปแก้ว

สาขาวิชา เศรษฐศาสตร์

คณะกรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์

รองศาสตราจารย์อดิ ไทยานันท์ ประธานกรรมการ

รองศาสตราจารย์สุกัญญา ตันชนวัฒน์

รองศาสตราจารย์อัมรินทร์ นัตราคม

มหาวิทยาลัยรามคำแหงอนุมัติให้วิทยานิพนธ์ฉบับนี้เป็นส่วนหนึ่งของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญาโทบริหารธุรกิจ



.....คณบดีบัณฑิตวิทยาลัย

(ผู้ช่วยศาสตราจารย์พิมล พุพิพิช)

คณะกรรมการสอบวิทยานิพนธ์

.....ประธานกรรมการ

(รองศาสตราจารย์ดร. ไกร โพธิ์งาม)

.....กรรมการ

(รองศาสตราจารย์อดิ ไทยานันท์)

.....กรรมการ

(รองศาสตราจารย์สุกัญญา ตันชนวัฒน์)

.....กรรมการ

(รองศาสตราจารย์อัมรินทร์ นัตราคม)

.....กรรมการ

(รองศาสตราจารย์ไกรสร คือประโคน)

## บทคัดย่อ

ชื่อเรื่องวิทยานิพนธ์ ราคาข้าวขาว 5% ในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย  
ชื่อผู้เขียน นางสาวพรรัชชล อุปแก้ว  
ชื่อปริญญา เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต  
ปีการศึกษา 2553

คณะกรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์

1. รองศาสตราจารย์อดิ ไทยานันท์ ประธานกรรมการ
2. รองศาสตราจารย์สุกัญญา ตันธนวัฒน์
3. รองศาสตราจารย์อัมรินทร์พงษ์ ฉัตราคม

249567

วัตถุประสงค์ของวิทยานิพนธ์ฉบับนี้ เพื่อจะศึกษาปัจจัยต่าง ๆ ที่มีผลต่อความเคลื่อนไหวของราคาข้าวขาว 5% ในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย และพยากรณ์แนวโน้มของราคาที่จะเกิดขึ้นในอนาคต โดยใช้วิธีทางสถิติ วิเคราะห์โดยใช้สมการถดถอยวิธีกำลังสองน้อยที่สุด ใช้ข้อมูลทุติยภูมิรายวันระหว่างวันที่ 1 มกราคม ถึง 31 ธันวาคม พ.ศ. 2552

ผลการศึกษาพบว่า ราคาข้าวขาว 5% ในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย มีความสัมพันธ์กับ อัตราแลกเปลี่ยนระหว่างเงินบาทต่อดอลลาร์สหรัฐอเมริกา ราคาขายส่งข้าวขาว 5% ของกรมการค้าภายใน ในทิศทางเดียวกัน และช่วงที่มีการเก็บเกี่ยวข้าวนาปีและข้าวนาปรัง ในทิศทางตรงกันข้าม ณ ความสำคัญทางสถิติที่ระดับความเชื่อมั่นร้อยละ 99 ซึ่งผลการศึกษาดตรงกับสมมติฐานที่ตั้งไว้ ส่วนการพยากรณ์แนวโน้มของราคาข้าวขาว 5% ในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย ในช่วงวันที่ 1 มกราคม ถึง 29 มกราคม พ.ศ. 2553 มีแนวโน้มของราคาลดลง แต่ก็มีมีความผันผวนของราคาสูง



rice as determined by the Department of Internal Trade. However, the time of harvest of main-season paddy and off-season paddy was found to be inversely correlated with the price of five percent white rice on the Agricultural Futures Exchange of Thailand at the statistically significant level of 99 percent. These findings were in accordance with the set hypothesis postulated for this inquiry.

In respect to forecasting the price trend of five percent white rice on the Agricultural Futures Exchange of Thailand for the 1 to 29 January 2010 period, the researcher forecasts a price decrease. Finally, also forecast is a tendency for the price level to fluctuate widely.

## กิตติกรรมประกาศ

วิทยานิพนธ์ฉบับนี้ สำเร็จลุล่วงเป็นอย่างดีได้ด้วยความร่วมมือและความอนุเคราะห์จากหลาย ๆ ท่าน โดยเฉพาะอย่างยิ่งผู้เขียนขอกราบขอบคุณอาจารย์ที่ปรึกษา รองศาสตราจารย์ ดร. ไกร โพธิ์งาม รองศาสตราจารย์อติ ไทยานันท์ รองศาสตราจารย์-สุกัญญา ตันธนวัฒน์ รองศาสตราจารย์อัมภินพวงศ์ ฉัตราคม และรองศาสตราจารย์-ไกรสร บุญประโคน ที่สละเวลาอันมีค่าของท่านในการแนะนำและแก้ไขวิทยานิพนธ์ฉบับนี้จนสำเร็จลุล่วงไปด้วยดี

ขอขอบพระคุณเจ้าของตำรา เอกสาร ผลงานและบทความทางวิชาการต่าง ๆ ที่ได้ใช้อ้างอิง และขอขอบคุณธนาคารแห่งประเทศไทย และสำนักงานเศรษฐกิจ-การเกษตรเป็นอย่างดี ขอขอบคุณบิดา มารดาและญาติพี่น้องที่คอยเป็นกำลังใจ รวมถึงเพื่อนร่วมงานสำนักงานคณะกรรมการกำกับและส่งเสริมการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ ที่คอยให้การสนับสนุน และเพื่อน ๆ นักศึกษาปริญญาโทคณะเศรษฐศาสตร์ รุ่นที่ 21 ที่ให้ความช่วยเหลือในการทำวิทยานิพนธ์ฉบับนี้

ประโยชน์และความสำเร็จอันพึงได้จากวิทยานิพนธ์ฉบับนี้ ผู้เขียนขอมอบแก่บิดา มารดา คณาจารย์ และผู้ที่มีส่วนเกี่ยวข้องทุกท่าน

พรรัชชล อุปแก้ว

## สารบัญ

	หน้า
บทคัดย่อภาษาไทย.....	(4)
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ.....	(5)
กิตติกรรมประกาศ.....	(7)
สารบัญตาราง.....	(10)
สารบัญภาพประกอบ.....	(11)
บทที่	
1 บทนำ.....	1
ความสำคัญของปัญหา.....	1
วัตถุประสงค์ของการศึกษา.....	6
ขอบเขตของการศึกษา.....	7
สมมติฐานของการศึกษา.....	7
วิธีการศึกษา.....	7
นิยามศัพท์เฉพาะ.....	10
ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ.....	11
2 แนวคิดทางทฤษฎี และวรรณกรรมที่เกี่ยวข้อง.....	13
แนวคิดทางทฤษฎี.....	13
วรรณกรรมที่เกี่ยวข้อง.....	24
3 การซื้อขายข้าวในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย.....	31
ข้าวขาว 5%.....	31
สาเหตุของการนำข้าวขาวมาซื้อขายล่วงหน้า.....	37
การใช้ราคาในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย เป็นราคาอ้างอิง.....	52

บทที่	หน้า
4	56
วิธีการศึกษา และผลการศึกษา .....	56
วิธีการศึกษา.....	56
ผลการศึกษา.....	58
5	63
สรุปผลการศึกษาและข้อเสนอแนะ .....	63
สรุปผลการศึกษา.....	63
ข้อเสนอแนะ.....	63
ภาคผนวก	
ก	65
ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา.....	65
ข	75
ผลการประมาณค่าทางสถิติ.....	75
บรรณานุกรม .....	79
ประวัติผู้เขียน.....	82

## สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
1 มูลค่าการส่งออกสินค้าสำคัญของไทย หมวดสินค้าเกษตรกรรม .....	1
2 การผลิตและการบริโภคข้าวของประเทศต่าง ๆ .....	3
3 ราคาส่งออกข้าวขาว 5% F.O.B. กรุงเทพมหานคร .....	4
4 ปริมาณและมูลค่าการนำเข้าปุ๋ยเคมีสูตรสำคัญ .....	4
5 ปริมาณและมูลค่าการนำเข้าสารกำจัดศัตรูพืช .....	5
6 ข้าวพันธุ์รับรอง พันธุ์แนะนำ และพันธุ์ทั่วไป .....	32
7 ชนิดหลักประกันและวัตถุประสงค์ของการเก็บหลักประกัน .....	46
8 มาตรฐานของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าข้าวขาว 5% .....	47
9 อัตราเงินประกันประเภทข้อตกลงแบบ Both options .....	49
10 อัตราเงินประกันประเภทข้อตกลงแบบส่งมอบรับมอบ .....	50
11 อัตราเงินประกันแบบสองด้าน (spread margin).....	50
12 ปริมาณการซื้อขายสินค้าเกษตรล่วงหน้า เดือนมกราคม ถึงเดือน มิถุนายน พ.ศ. 2553 .....	51
13 ปริมาณการซื้อขายข้าวขาว 5% เดือนมกราคม ถึงเดือนมิถุนายน พ.ศ. 2553.....	52
14 การจำหน่ายข้าวสารในสต็อกของรัฐบาล โดยใช้กลไกของตลาดสินค้า- เกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย.....	55
15 ผลการพยากรณ์ราคาข้าวขาว 5% ในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่ง- ประเทศไทย ในช่วงวันที่ 1 ถึง 29 เดือนมกราคม พ.ศ. 2553 .....	62
16 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา.....	65
17 ผลที่ได้จากการศึกษา (1).....	76
18 ผลที่ได้จากการศึกษา (2).....	77

## สารบัญภาพประกอบ

ภาพ	หน้า
1	15
2	17
3	17
4	19
5	40
6	42
7	79