

ชื่อเรื่องวิทยานิพนธ์ ประสิทธิภาพราคาในตลาดน้ำมันปาล์มของประเทศไทย

ผู้เขียน นายรหัท รวมพรรณพงศ์

ปริญญา วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต (เศรษฐศาสตร์เกษตร)

คณะกรรมการที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์

ผศ.ดร.พัฒนา เจียรวิริยะพันธ์ ประธานกรรมการ

รศ.ดร.อารี วิบูลย์พงศ์ กรรมการ

รศ.ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ กรรมการ

บทคัดย่อ

การศึกษาประสิทธิภาพราคาในตลาดน้ำมันปาล์มของประเทศไทย มีวัตถุประสงค์เพื่อทราบถึงระบบการตั้งราคาในตลาดปาล์มน้ำมันในประเทศ และการส่งผ่านราคาระหว่างตลาดแต่ละระดับ ข้อมูลราคาที่ใช้ ได้แก่ ราคาผลปาล์มสด ราคาน้ำมันปาล์มดิบภายในประเทศ ราคาน้ำมันปาล์มบริสุทธิ์ภายในประเทศ และราคาน้ำมันปาล์มดิบของประเทศมาเลเซีย ข้อมูลที่ใช้เป็นข้อมูลรายสัปดาห์ซึ่งได้จากการเฉลี่ยข้อมูลรายวันตั้งแต่วันที่ 13 พฤษภาคม พ.ศ. 2546 ถึง วันที่ 16 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2550 รวมทั้งหมด 197 สัปดาห์ โดยอ้างอิงจากกรมการค้าภายใน กระทรวงพาณิชย์ การวิเคราะห์การส่งผ่านราคา ได้ใช้แบบจำลอง Vector Autoregressive (VAR) และทดสอบ Cointegration ตามวิธีของ Johansen and Juselius เพื่อหาความสัมพันธ์ระยะยาว และใช้แบบจำลอง Vector Error Correction (VEC) เพื่อหาความสัมพันธ์ระยะสั้น

ผลการศึกษากระบวนการตั้งราคาน้ำมันปาล์มภายในประเทศ พบว่าการตั้งราคามีรูปแบบและวิธีการที่แตกต่างกันตามชนิดของสินค้า โดยสรุประบบราคาที่สำคัญได้แก่ (1) การตั้งราคาผลปาล์มสด โรงงานสกัดน้ำมันปาล์มดิบจะเป็นผู้กำหนดราคาโดยพิจารณาจากราคาน้ำมันปาล์มดิบและสัดส่วนการให้น้ำมันของผลปาล์มสด ส่วนพ่อค้ารวบรวมทองถิ่นและกลุ่มสหกรณ์นิคมจะให้ราคาตามราคาการประกาศของโรงงานสกัดน้ำมันปาล์มดิบหรือต่ำกว่าเล็กน้อย (2) การตั้งราคาน้ำมันปาล์มดิบ จะเกิดจากการตกลงร่วมกันระหว่างโรงงานสกัดน้ำมันปาล์มดิบและโรงงานกลั่นน้ำมันปาล์มบริสุทธิ์ และ (3) การตั้งราคาน้ำมันปาล์มบริสุทธิ์ โรงงานกลั่นน้ำมันปาล์มบริสุทธิ์จะเป็นผู้ตั้ง

ราคาโดยพิจารณาจากต้นทุนการแปรรูปและราคาน้ำมันปาล์มดิบ โดยมักจะต้องพิจารณาราคาน้ำมันพืชทดแทนชนิดอื่นๆร่วมด้วย

ผลการประมาณแบบจำลอง VAR พบว่าจำนวนตัวแปรล่า (lag) ที่เหมาะสมมีค่าเท่ากับ 2 สัปดาห์ และจากการทดสอบ Cointegration ด้วยวิธีของ Johansen and Juselius พบว่ามี Cointegrating vector จำนวน 2 vectors ซึ่งหมายถึงตัวแปรราคามีความสัมพันธ์กันในระยะยาวอยู่ 2 สมการ คือ (1) ราคาผลปาล์มสด มีความสัมพันธ์ในระยะยาวกับราคาน้ำมันปาล์มบริสุทธิ์ในประเทศ โดยมีค่าความยืดหยุ่นต่อราคาเท่ากับ 1.18 แต่ไม่มีความสัมพันธ์ในระยะยาวกับราคาน้ำมันปาล์มดิบของประเทศมาเลเซีย และ (2) ราคาน้ำมันปาล์มดิบในประเทศ มีความสัมพันธ์ในระยะยาวทั้งกับราคาน้ำมันปาล์มบริสุทธิ์ในประเทศ และกับราคาน้ำมันปาล์มดิบของมาเลเซีย โดยมีค่าความยืดหยุ่นต่อราคาเท่ากับ 0.89 และ 0.34 ตามลำดับ และจากการทดสอบประสิทธิภาพราคา พบว่า ค่าความยืดหยุ่นของราคาผลปาล์มสดต่อราคาน้ำมันปาล์มบริสุทธิ์ และค่าความยืดหยุ่นของราคาน้ำมันปาล์มดิบในประเทศต่อราคาน้ำมันปาล์มบริสุทธิ์ในประเทศ มีค่าไม่แตกต่างจากไปจาก 1.00 อย่างมีนัยสำคัญทางสถิติที่ระดับความเชื่อมั่นร้อยละ 90 จึงสรุปได้ว่าการส่งผ่านราคาจากตลาดน้ำมันปาล์มบริสุทธิ์ในประเทศไปยังตลาดน้ำมันปาล์มดิบในประเทศและตลาดผลปาล์มสดเป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ ส่วนราคาน้ำมันปาล์มดิบของประเทศมาเลเซียมีความสัมพันธ์ระยะยาวเฉพาะกับราคาน้ำมันปาล์มดิบในประเทศเท่านั้น

สำหรับผลการประมาณแบบจำลอง VEC ที่มีตัวแปรล่าเท่ากับ 2 สัปดาห์ พบว่า มีเพียง 2 สมการเท่านั้นที่สามารถอธิบายการปรับตัวของราคาในระยะสั้น (error correction term) ได้ คือ (1) สมการการปรับตัวระยะสั้นของราคาผลปาล์มสด มีค่าสัมประสิทธิ์การปรับตัวในระยะสั้นเท่ากับ -0.1317 ซึ่งอธิบายได้ว่า เมื่อราคาผลปาล์มสดแกว่งตัวออกนอกดุลยภาพ (shock) ไปร้อยละ 1 ราคาผลปาล์มสดจะปรับเข้าสู่ดุลยภาพในอัตราร้อยละ 0.1317 ในสัปดาห์ถัดไป และ (2) สมการการปรับตัวระยะสั้นของราคาน้ำมันปาล์มดิบในประเทศ มีค่าสัมประสิทธิ์การปรับตัวในระยะสั้นเท่ากับ -0.1350 (แต่มีนัยสำคัญทางสถิติต่ำ) ซึ่งอธิบายได้ว่าเมื่อราคาน้ำมันปาล์มดิบในประเทศแกว่งตัวออกนอกดุลยภาพไปร้อยละ 1 ราคาน้ำมันปาล์มดิบจะปรับตัวกลับเข้าสู่ดุลยภาพในอัตรา ร้อยละ 0.1350 ในสัปดาห์ถัดไป

จากการทดสอบความสัมพันธ์ทั้งในระยะยาวและระยะสั้น สรุปได้ว่า ตลาดน้ำมันปาล์มในประเทศเป็นตลาดที่มีประสิทธิภาพทางด้านราคา ซึ่งจากความสัมพันธ์ในระยะยาว ราคาน้ำมันปาล์มบริสุทธิ์ได้ถูกส่งผ่านไปยังราคาผลปาล์มสด และราคาน้ำมันปาล์มดิบในประเทศอย่างเต็มที่ และค่าสัมประสิทธิ์ของพจน์การปรับตัวในระยะสั้น ของราคาผลปาล์มสดและราคาน้ำมันปาล์มดิบยังมีค่าที่ใกล้เคียงกันมาก

จากผลการศึกษา สามารถสรุปได้ว่าตลาดน้ำมันปาล์มในประเทศมีประสิทธิภาพทางด้านราคา ดังนั้นการใช้นโยบายแทรกแซงราคาโดยรัฐจึงเป็นสิ่งที่ไม่จำเป็น แต่ควรมีการปรับปรุงระบบข้อมูลข่าวสารเพื่อให้ให้เกษตรกรสามารถมีการรับรู้ข้อมูลข่าวสารด้านการตลาด โดยเฉพาะราคาน้ำมันปาล์มดิบ และราคาน้ำมันปาล์มบริสุทธิ์ในประเทศ รวมถึงวิธีการคิดคำนวณราคาผลปาล์มสด เพื่อให้เกษตรกรได้พิจารณาถึงความเหมาะสมของราคาที่ได้รับในขณะนั้น และสุดท้ายความสัมพันธ์ของราคาน้ำมันปาล์มดิบในประเทศกับราคาน้ำมันปาล์มดิบของประเทศมาเลเซียนั้น เป็นสัญญาณที่บ่งบอกว่าหากมีการเปิดการค้าเสรีอย่างเต็มที่แล้ว ราคาน้ำมันปาล์มดิบในประเทศไทยจะต้องลดลงตามราคาของประเทศมาเลเซียอย่างแน่นอน ดังนั้นอุตสาหกรรมน้ำมันปาล์มของประเทศไทย จึงต้องเร่งพัฒนาโดยเฉพาะอย่างยิ่ง การหาวิธีการที่สามารถจะลดต้นทุนการผลิต เพื่อให้สามารถแข่งขันทางด้านราคากับประเทศมาเลเซียได้