

วัลลภา เย็นระยับ 2550: การวิเคราะห์การเคลื่อนไหวราคาและความเชื่อมโยงราคาข้าวโพด
ฝักอ่อนและผลิตภัณฑ์ ปริญาวิทยาศาสตร์มหาบัณฑิต (เศรษฐศาสตร์เกษตร)
สาขาเศรษฐศาสตร์เกษตร ภาควิชาเศรษฐศาสตร์เกษตรและทรัพยากร
ประธานกรรมการที่ปรึกษา: รองศาสตราจารย์สมพร อิศวิลานนท์, M.A. 140 หน้า

การศึกษาค้นคว้าครั้งนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อ (1) วิเคราะห์การเคลื่อนไหวราคาข้าวโพดฝักอ่อนและ
ผลิตภัณฑ์และการพยากรณ์ราคาโดยใช้ ARIMA model และ (2) เพื่อวิเคราะห์ความเชื่อมโยงราคาในตลาด
แต่ละระดับ ด้วยวิธีการ cointegration โดยใช้ข้อมูลอนุกรมเวลาข้าวโพดฝักอ่อนและผลิตภัณฑ์ในช่วงเดือน
มกราคม พ.ศ. 2541 ถึงเดือนธันวาคม พ.ศ. 2547

ผลการศึกษาโดยใช้ ARIMA model พบว่าทุกชุดข้อมูลอนุกรมเวลา มีคุณสมบัติ stationary ใน
แนวระดับ ลักษณะดังกล่าวสามารถนำมาใช้ในการพยากรณ์ได้ โดยราคาข้าวโพดฝักอ่อนที่ฟาร์มมี
ความสัมพันธ์กับราคาในช่วง 2 เดือนที่ผ่านมา ในกรณีของตลาดกรุงเทพฯ พบว่า ราคาขายปลีกมี
ความสัมพันธ์กับปัจจัยอื่นที่ไม่ใช่ราคาในช่วง 2 เดือนที่ผ่านมา ส่วนราคาขายส่ง นอกจากจะมี
ความสัมพันธ์กับราคาในช่วง 2 เดือนที่ผ่านมาแล้ว ยังมีความสัมพันธ์กับปัจจัยอื่นที่ไม่ใช่ราคาในเดือนที่
ผ่านมาด้วย ในตลาดส่งออกพบว่าราคาส่งออกผลิตภัณฑ์ข้าวโพดฝักอ่อนแช่เย็นและข้าวโพดฝักอ่อน
กระป๋องไปยังประเทศญี่ปุ่น มีความสัมพันธ์กับราคาและปัจจัยอื่นที่ไม่ใช่ราคาในเดือนที่ผ่านมา ส่วนราคา
ส่งออกข้าวโพดฝักอ่อนแช่เย็นไปยังสหราชอาณาจักรมีความสัมพันธ์กับราคาในเดือนที่ผ่านมา ในขณะที่
ราคาส่งออกข้าวโพดฝักอ่อนกระป๋องไปยังสหรัฐอเมริกา มีความสัมพันธ์กับราคาและปัจจัยอื่นที่ไม่ใช่
ราคาในช่วง 2 เดือนที่ผ่านมา

ในการศึกษาความเชื่อมโยงราคา ผลการศึกษาพบว่ามีความเชื่อมโยงราคาในทิศทางเดียวจากราคา
ขายส่งข้าวโพดฝักอ่อน ณ ตลาดกรุงเทพฯ ไปยังราคาส่งออกข้าวโพดฝักอ่อนแช่เย็นไปสหราชอาณาจักร
และประเทศญี่ปุ่น นอกจากนี้ได้พบความเชื่อมโยงราคาระหว่างราคาขายส่งข้าวโพดฝักอ่อน ณ ตลาด
กรุงเทพฯ กับราคาส่งออกข้าวโพดฝักอ่อนกระป๋องไปยังประเทศญี่ปุ่นอีกด้วย