

อঞ্জรา ว่องไวไพโรจน์ 2554: การวิเคราะห์การเคลื่อนไหวราคาและความเชื่อมโยงราย
ข้างแผ่นรมคว้นชั้น 3 ของประเทศไทย ปริญญาวิทยาศาสตรมหาบัณฑิต
(เศรษฐศาสตร์เกษตร) สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์เกษตร ภาควิชาเศรษฐศาสตร์เกษตรและ
ทรัพยากร อาจารย์ที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์หลัก: ผู้ช่วยศาสตราจารย์วิศิษฐ์ ลิ้มสมบุญชัย,
Ph.D. 139 หน้า

การศึกษาในครั้งนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อวิเคราะห์พฤติกรรมการเคลื่อนไหวราคาข้างแผ่น
รมคว้นชั้น 3 และเพื่อวิเคราะห์ความเชื่อมโยงของรายข้างแผ่นรมคว้นชั้น 3 ทั้งในระดับแนวตั้ง
และแนวนอน โดยอาศัยข้อมูลอนุกรมเวลารายเดือนตั้งแต่เดือนมกราคม 2546 ถึงเดือนธันวาคม
2553 จำนวน 96 เดือน

ผลการวิเคราะห์การเคลื่อนไหวของราคาตามฤดูกาล ด้วยวิธีการวิเคราะห์แบบแยก
องค์ประกอบ (Decomposition Method) พบว่า ดัชนีราคาตามฤดูกาลของทุกตลาดไปในทิศทาง
เดียวกัน กล่าวคือ ดัชนีราคาจะสูงสุดในช่วงเดือนพฤษภาคมถึงเดือนมิถุนายน เนื่องจากเป็นช่วง
รอยต่อของฤดูยางปิดกรีด ทำให้อุปทานยางน้อยกว่าอุปสงค์ยาง และดัชนีราคาตามฤดูกาลต่ำสุด
ในช่วงเดือนธันวาคม เนื่องจากเป็นปลายฤดูฝน ปริมาณยางจะเข้าสู่ตลาดมากในช่วงเวลานี้
นอกจากนี้ยังพบว่า แนวโน้มของรายข้างในทุกลาดเพิ่มขึ้นตามเวลาอย่างมีนัยสำคัญทางสถิติ
(เฉลี่ยปีละ 7.38 บาท) ผลการวิเคราะห์ความเชื่อมโยงรายข้างในแต่ละตลาดพบว่า ตลาดที่มีอิทธิพล
ส่งผลให้เกิดการเปลี่ยนแปลงในตลาดอื่นที่สำคัญในระดับตลาดต่างประเทศ คือ ตลาดล่วงหน้า
โตเกียว ในระดับตลาดกลาง คือ ตลาดกลางหาดใหญ่ ในระดับตลาดท้องถิ่น คือ ตลาดท้องถิ่น
สุราษฎร์ธานี ทั้งนี้คู่ตลาดที่มีความสัมพันธ์ซึ่งกันและกันแนวนอน คือ ตลาดล่วงหน้าโตเกียว
กับตลาดล่วงหน้าสิงคโปร์ ตลาดกลางหาดใหญ่กับตลาดกลางนครศรีธรรมราชและตลาดกลาง
สุราษฎร์ธานี ตลาดท้องถิ่นสุราษฎร์ธานีกับกับตลาดท้องถิ่นนครศรีธรรมราชและตลาดท้องถิ่น
หาดใหญ่ โดยตลาดที่มีความสัมพันธ์ซึ่งกันและกันแนวตั้ง ได้แก่ ตลาดล่วงหน้าโตเกียวกับ
ตลาดกรุงเทพ ตลาดกรุงเทพกับตลาดกลางนครศรีธรรมราช และยังพบอีกด้วยว่า ตลาดกลาง
หาดใหญ่มีความสัมพันธ์ซึ่งกันและกันแนวตั้งกับตลาดในระดับท้องถิ่นในทุกลาด