

สารบัญ

	หน้า
สารบัญตาราง	(4)
สารบัญภาพ	(7)
บทที่ 1 บทนำ	1
ความสำคัญของปัญหา	1
วัตถุประสงค์ของการศึกษา	3
ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ	3
ขอบเขตของการศึกษา	3
วิธีการศึกษา	5
บทที่ 2 ตรวจสอบเอกสารและโครงสร้างทางทฤษฎี	7
การศึกษาที่เกี่ยวข้องกับตลาดยางพารา	7
การศึกษาที่เกี่ยวข้องกับการพยากรณ์ราคายางพารา	9
การศึกษาที่เกี่ยวข้องกับระดับราคา	10
กรอบแนวคิดทางทฤษฎี	14
ทฤษฎีตลาดที่มีประสิทธิภาพ	14
ความเชื่อมโยงตลาด	16
วิธีการพยากรณ์ราคายางพาราในตลาดต่างๆด้วยวิธีการ Box – Jenkins	29
บทที่ 3 สภาพทั่วไปของการผลิต การใช้ การส่งออก และการตลาดยางพารา	33
สภาพทั่วไปของการผลิต	33
ประวัติการเพาะปลูกยางพาราของโลก	33
การผลิตยางพาราของโลก	34
ประวัติการเพาะปลูกยางพาราของไทย	37

สารบัญ (ต่อ)

	หน้า
การผลิตยางพาราของไทย	37
การใช้ยางพาราของโลก	40
การส่งออกยางพาราของไทย	42
สภาพการตลาดยางพารา	45
สถาบันต่างๆในตลาดยางธรรมชาติของไทย	47
วิธีการตลาดยางพารา	49
ประเภทของตลาดยางพารา	52
ตลาดยางในประเทศ	52
ตลาดยางในต่างประเทศ	52
การก่อตัวของราคายางพารา	54
นโยบายและแผนพัฒนายางพาราของไทย	57
หน่วยงานของภาครัฐบาลที่เกี่ยวข้องกับนโยบายยางพารา ของประเทศไทย	57
นโยบายยางพาราและมาตรการของประเทศไทยที่ผ่านมา	58
นโยบายยางพาราของประเทศไทยในปัจจุบัน	64
บทที่ 4 ผลการวิเคราะห์	
ผลการวิเคราะห์ความเชื่อมโยงตลาดและการส่งผ่านราคายางพาราใน 5 ตลาด	67
การทดสอบความหยุดนิ่ง การระบุระดับของ integration และการเลือก ช่วงเวลาที่เหมาะสม	69
การทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาว และการวิเคราะห์การ ส่งผ่านราคา	71
การกะประมาณแบบจำลอง VEC	83
ผลการพยากรณ์ราคาด้วยแบบจำลอง ARIMA ของราคายางพาราในตลาดต่างๆ	89

สารบัญ (ต่อ)

	หน้า
บทที่ 5 สรุปและข้อเสนอแนะ	93
สรุปผลการวิเคราะห์	93
ข้อเสนอแนะเชิงนโยบาย	98
ข้อเสนอแนะการวิเคราะห์เชิงเทคนิค	99
ข้อจำกัดในการศึกษา	99
เอกสารและสิ่งอ้างอิง	101
ภาคผนวก	114
ภาคผนวก ก ข้อมูลที่ใช้ในการวิเคราะห์	115
ภาคผนวก ข ผลการวิเคราะห์	121
ภาคผนวก ค รูปภาพประกอบ	147

สารบัญตาราง

ตารางที่		หน้า
1	ยางพารา: เนื้อที่ปลูก ผลผลิต และผลผลิตต่อไร่ ของประเทศผู้ผลิตที่สำคัญ ปี พ.ศ. 2545 – 2548	4
2	ปริมาณผลผลิตยางพาราของประเทศผู้ผลิตที่สำคัญ ปี พ.ศ. 2540-2548	36
3	พื้นที่ปลูกยางพาราของไทยแยกตามภาค ปี พ.ศ. 2539 และปี พ.ศ. 2546	39
4	การผลิต การใช้ และสต็อกของยางพาราโลก ปี พ.ศ. 2538 - 2548	41
5	ปริมาณการผลิตรถยนต์ในประเทศจีน พ.ศ. 2533 – 2547	41
6	ปริมาณส่งออกยางพาราธรรมชาติของประเทศผู้ผลิตที่สำคัญของโลกปี พ.ศ. 2540 – 2548	43
7	ปริมาณการส่งออกยางแยกตามประเภทของไทย พ.ศ. 2540 - 2548	44
8	ปริมาณส่งออกยางพาราแผ่นรมควันแยกตามชั้น ปี พ.ศ. 2540 – 2548	44
9	ปริมาณการส่งออกยางพาราไปยังประเทศผู้ซื้อปลายทาง ปี พ.ศ. 2540 – 2548	45
10	ผลผลิตยางธรรมชาติของไทย พ.ศ. 2536 - 2548	46
11	อัตราผลตอบแทนระหว่างเจ้าของสวนยางและคนกรีดยาง	48
12	ผลการทดสอบระดับ Integration ของราคายางพารา ณ ตลาดต่างๆ ที่ทำการศึกษา	69
13	ผลการทดสอบช่วงความล่าช้าที่เหมาะสมระหว่างระดับราคาในตลาดคู่ต่างๆ	70
14	การทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาวระหว่างราคาตลาดโตเกียว (TO) กับราคาตลาดหาดใหญ่ (HA)	72

สารบัญตาราง (ต่อ)

ตารางที่		หน้า
15	การทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาวระหว่างราคาตลาดสิงคโปร์ (SI) และราคาตลาดหาดใหญ่ (HA)	76
16	การทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาวระหว่างราคาราคาตลาดโตเกียว (TO) กับราคาตลาดสิงคโปร์ (SI)	78
17	การทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาวระหว่างราคาตลาดหาดใหญ่ (HA) กับราคาตลาดสงขลา (SO)	80
18	การทดสอบความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาวระหว่างราคาตลาดหาดใหญ่ (HA) กับ ราคาตลาดสุราษฎร์ธานี (SU)	82
ตารางผนวกที่		
ก1	ราคายางพาราแผ่นรมควันชั้นที่ 3 ณ ตลาดสำคัญต่างๆ ทั้งในประเทศและต่างประเทศ ตั้งแต่เดือนมกราคม ปี พ.ศ. 2543 ถึงเดือนธันวาคม พ.ศ. 2548	116
ก2	พื้นที่เพาะปลูกยางพาราของโลก ปี พ.ศ. 2548	119
ก3	ปริมาณผลผลิตยางธรรมชาติของประเทศไทยแยกตามประเภท ปี พ.ศ. 2540 – 2548	120
ข1	ผลการทดสอบแบบจำลอง VEC ระหว่างราคาตลาดโตเกียว (TO) กับระดับราคาในตลาดกลางหาดใหญ่ (HA)	122
ข2	ผลการทดสอบแบบจำลอง VEC ระหว่างราคาตลาดสิงคโปร์(SI) กับระดับราคาในตลาดกลางหาดใหญ่ (HA)	123
ข3	ผลการทดสอบแบบจำลอง VEC ระหว่างราคาตลาดโตเกียว (TO) กับระดับราคาในตลาดสิงคโปร์(SI)	124

สารบัญตาราง (ต่อ)

ตารางผนวกที่		หน้า
ข4	ผลการทดสอบแบบจำลอง VEC ระหว่างราคาตลาดขนาดใหญ่ (HA) กับระดับราคาตลาดสุราษฎร์ธานี (SU)	125
ข5	ผลการทดสอบแบบจำลอง VEC ระหว่างราคาตลาดขนาดใหญ่ (HA) กับระดับราคาตลาดสงขลา (SO)	126
ข6	ค่า acf. และ pacf. ของอนุกรมเวลาผลต่างราคาขางพาราตลาดกลางพาราอำเภอหาดใหญ่ ครั้งที่ 1	127
ข7	ค่า acf. และ pacf. ของอนุกรมเวลาคลาดเคลื่อนราคาขางพาราตลาดกลางพาราอำเภอหาดใหญ่	129
ข8	ค่า acf. และ pacf. ของอนุกรมเวลาผลต่างราคาขางพาราตลาดโตเกียว ครั้งที่ 1	131
ข9	ค่า acf. และ pacf. ของอนุกรมเวลาคลาดเคลื่อนราคาขางพาราตลาดโตเกียว	133
ข10	ค่า acf. และ pacf. ของอนุกรมเวลาผลต่างราคาขางพาราตลาดสิงคโปร์ ครั้งที่ 1	135
ข11	ค่า acf. และ pacf. ของอนุกรมเวลาคลาดเคลื่อนราคาขางพาราตลาดสิงคโปร์	137
ข12	ค่า acf. และ pacf. ของอนุกรมเวลาผลต่างราคาขางพาราตลาดสุราษฎร์ธานี ครั้งที่ 1	139
ข13	ค่า acf. และ pacf. ของอนุกรมเวลาคลาดเคลื่อนราคาขางพาราตลาดสุราษฎร์ธานี	141
ข14	acf. และ pacf. ของอนุกรมเวลาผลต่างราคาขางพาราตลาดสงขลา ครั้งที่ 1	143
ข15	ค่า acf. และ pacf. ของอนุกรมเวลาคลาดเคลื่อนราคาขางพาราตลาดสงขลา	145

สารบัญภาพ

ภาพที่		หน้า
1	ขั้นตอนการหาความสัมพันธ์ของราคา ใน แต่ละตลาด	19
2	วิธีการตลาดยางของประเทศไทยกรณีเป็นสวนยางขนาดเล็ก	50
3	วิธีการตลาดยางพาราของประเทศไทยกรณีเป็นสวนยางขนาดใหญ่	51
4	สรุปค่าความยืดหยุ่นของการส่งผ่านราคาในตลาดต่างๆบนสมมติฐานราคาในตลาดที่ระดับสูงกว่าจะส่งผ่านราคามายังตลาดในระดับที่ต่ำกว่า	82
5	สรุปการปรับตัวเข้าสู่ดุลยภาพในระยะยาวและความเร็วในการปรับตัว	88
ภาพผนวกที่		
ก1	เว็บไซต์แสดงราคาขายพารารมควันชั้นที่ 3 ของ ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย	148
ก2	เว็บไซต์แสดงราคาขายพารารมควันชั้นที่ 3 ของตลาดสิงคโปร์	149
ก3	เว็บไซต์แสดงราคาขายพารารมควันชั้นที่ 3 ที่ประกาศในประเทศไทยโดยสถาบันวิจัยยาง	150