

สุจามร ยิมละมัย 2554: การวิเคราะห์ประสิทธิภาพของราคาของพาราในตลาดสินค้าเกษตร
ล่วงหน้าแห่งประเทศไทย ปริญาวิทยาสตรมหาบัณฑิต (เศรษฐศาสตรเกษตร)
สาขาวิชาเศรษฐศาสตรเกษตร ภาควิชาเศรษฐศาสตรเกษตรและทรัพยากร
อาจารย์ที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์หลัก: รองศาสตราจารย์นภกรณั พรหมชนะ, วท.ม. 106 หน้า

การวิจัยนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อทำการวิเคราะห์ประสิทธิภาพราคาของตลาดสินค้าเกษตร
ล่วงหน้าแห่งประเทศไทย โดยการทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างราคาในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้า
แห่งประเทศไทย และราคาในตลาดปัจจุบัน ของยางแผ่นรมควันชั้น 3 ทั้งตลาดกลางท่าเรือกรุงเทพฯ
และตลาดกลางหาดใหญ่ ระหว่างเดือนกันยายน 2547 ถึงเดือนสิงหาคม 2553 โดยวิเคราะห์ค่าดัชนี
ราคาตามฤดูกาลและใช้แบบจำลอง Error Correction Model (ECM) มาทำการวิเคราะห์
ประสิทธิภาพราคา

ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทยที่มีประสิทธิภาพนั้น ราคาซื้อขายล่วงหน้าและ
ราคาในตลาดปัจจุบันต้องสะท้อนถึงมูลค่าที่แท้จริงของสินค้า การซื้อขายในตลาดสินค้าเกษตร
ล่วงหน้าแห่งประเทศไทย ช่วงแรกของการเปิดทำการซื้อขายในตลาดล่วงหน้าแห่งประเทศไทย
พบว่า มีผู้ที่เข้ามาทำการซื้อขายโดยไม่ระบุประเภทมากที่สุด แต่เมื่อเปิดทำการมาถึงปัจจุบันเป็น
ระยะเวลา 6 ปี ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทยได้สร้างความเชื่อมั่นให้กับเกษตรกร
หรือผู้ประกอบการที่เกี่ยวข้องกับสินค้าเกษตรและนักลงทุนในประเทศเพิ่มมากขึ้น และรูปแบบที่
นิยมซื้อขายมากที่สุดในปัจจุบันคือสัญญาก่อนครบกำหนดส่งมอบ 7 เดือน จากการดำเนินงานค่า
ดัชนีราคาตามฤดูกาลในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทยมีเสถียรภาพมากกว่าตลาด
ปัจจุบันทั้ง 2 ตลาด และเมื่อวิเคราะห์ทางสถิติโดยแบบจำลอง Error Correction Model (ECM)
พบว่าตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทยยังไม่มีประสิทธิภาพ แต่เมื่อพิจารณาในภาพรวม
อาจสรุปได้ตามทฤษฎีประสิทธิภาพของตลาด อาจกล่าวได้ว่าตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่ง
ประเทศไทย เป็นตลาดที่มีประสิทธิภาพในระดับกลาง (Semi Strong Efficiency) เนื่องจากยังมี
ปัจจัยอื่นๆที่คาดการณ์การเปลี่ยนแปลงส่วนต่างของราคาได้

ดังนั้นควรให้ความรู้ผู้ที่เกี่ยวข้องทราบถึงธรรมชาติของการเคลื่อนไหวของราคาของแผ่น
รมควันชั้น 3 ทั้งในตลาดปัจจุบันและตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย

ลายมือชื่อนิติสด

ลายมือชื่ออาจารย์ที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์หลัก