

ชื่อเรื่องการค้าค้นคว้าแบบอิสระ

การวิเคราะห์ความผันผวนของมูลค่าการส่งออกข้าว

หอมมะลิไทย

ผู้เขียน

นางสาวสุวิทย์รา ตันตราวัฒน์

ปริญญา

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้าค้นคว้าแบบอิสระ

อ.ดร.พทย์รัตน์ ภาสพิพัฒน์กุล

อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก

อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์กุล

อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

บทคัดย่อ

การศึกษาค้นคว้าครั้งนี้ มีวัตถุประสงค์ที่จะศึกษาวิเคราะห์แบบจำลองความผันผวนมูลค่าการส่งออกข้าวหอมมะลิไทย โดยใช้ข้อมูลอนุกรมเวลารายเดือน ตั้งแต่เดือนมกราคม ปี 2543 ถึงเดือนธันวาคม ปี 2555 โดยทำการศึกษามูลค่าการส่งออกข้าวหอมมะลิของไทย ทั้งสิ้น 156 ข้อมูล และวิธีที่ใช้ศึกษาแบ่งออกเป็น 2 ส่วน คือ ส่วนที่ 1 ศึกษาลักษณะโครงสร้างของข้าวหอมมะลิไทย ด้านการค้า และกลยุทธ์ทางการตลาด ส่วนที่ 2 โดยวิธีทางเศรษฐมิติได้แก่ การทดสอบความนิ่ง (Unit Root Test) การทดสอบ ARIMA (Autoregressive and Moving Average) และประมาณค่าเฉลี่ยโดยวิธีการทดสอบ ARCH (Autoregressive Conditional Heteroscedasticity) ความผันผวนและการประมาณค่าความผันผวนแบบมีเงื่อนไขตัวแปรเดียวโดยแบบจำลอง GARCH (Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity)

ข้าวหอมมะลิมิถุนกำเนิดในประเทศไทย พันธุ์ที่ปลูกและบริโภค คือ ขาวดอกมะลิ 105 และ พันธุ์กข.15 ซึ่งได้รับความนิยมอย่างมากในตลาดต่างประเทศเนื่องจากเป็นข้าวที่มีคุณภาพและมีกลิ่นหอมคล้ายใบเตย ตลาดส่งออกที่สำคัญ ได้แก่ อิรัก ไนจีเรีย สหรัฐอเมริกา แอฟริกาใต้ โดยที่รัฐบาลไทยได้มีการกำหนดเป้าหมายในระยะยาวคือการขยายตลาดส่งออกข้าวหอมมะลิ และได้จัดแสดงในงานต่างๆ เน้นกลุ่มผู้บริโภคที่มีฐานะ ผู้ที่เอาใจใส่ต่อสุขภาพ และผู้ที่บริโภคข้าวเป็นหลัก

ผลการศึกษาความนิ่ง(Unit Root Test)ของข้อมูล ข้อมูลมีลักษณะหนึ่งที่อันดับความสัมพันธ์ของข้อมูลอันดับ(Order of Integration) ที่ 1 หรือ I(1) จากการศึกษาการประมาณมูลค่าการส่งออกข้าวหอมมะลิที่ได้จากแบบจำลอง ARIMA พบว่ารูปแบบของอนุกรมเวลาที่เหมาะสมคือ AR(1) MA(1) SAR(13) SMA(13) การทดสอบ ARCH Effect เพื่อการประมาณค่าโดยใช้แบบจำลอง GARCH พบรูปแบบที่เหมาะสมคือ GARCH(1,1) การพยากรณ์พบว่ามูลค่าการส่งออกข้าวหอมมะลิไทยในช่วงปีพ.ศ.2556 - 2558 มีมูลค่าลดลงจากปีพ.ศ.2555 ดังนั้นผลการศึกษาได้เสนอแนวทางแก้ไขดังนี้ ในระยะสั้นเสนอให้ลดปริมาณการผลิตลงเนื่องจากนโยบายจํานําข้าวที่ทำให้ปริมาณสต็อกข้าวอยู่ในระดับสูง ในระยะยาวเสนอให้เพิ่มราคาการจัดหาตลาดต่างประเทศ และเน้นการผลิตที่มีคุณภาพมากขึ้น

Independent Study Title An Analysis of Thai Jasmine Rice Export Value Volatility

Author Ms. Suthira Tantrawat

Degree Master of Economics

Independent Study Advisory Committee

Lecturer Dr. Pathirat Pastpipatkul Advisor

Lecturer Dr. Chaiwat Nimanussornkul Co-advisor

ABSTRACT

The objective of this study is to analyze Thai Jasmine Rice export value volatility using a monthly series basis from January 2000 to December 2012 using 156 sets of Thai Jasmine Rice export value data. The study is divided into 2 parts: The first studies the structure of Thai Jasmine Rice merchandising and marketing strategy and the second uses the econometric method of Unit Root Test, ARIMA (Autoregressive Integrated and Moving Average), ARCH (Autoregressive Conditional Heteroscedasticity) and GARCH (Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity).

Thai Jasmine Rice originated in Thailand. Two types consumed and grown are Khao Dawk Mali 105 and RD15, which are very popular in foreign markets because they have good quality and smell like the Pandanus leaf. The major markets are Iraq, Nigeria, the USA and South Africa. The Thai government's long-term goals are to expand the export market and promote Thai Jasmine Rice to wealthy consumer groups, health-conscious consumer groups and rice eaten consumer groups.

The results from the Unit Root Test of data suggested using stationary to Order of Integration 1 or I(1). The study of estimated volume of Thai Jasmine Rice export derived from the ARIMA model found that the appropriate model series are AR(1), MA(1), SAR(13) and

SMA(13). The ARCH Effect test to estimate results using the GARCH model found that the appropriate model is GARCH (1,1). The estimated export values of Thai Jasmine Rice between 2013 - 2015 are predicted to fall from 2012. Results from the study suggest the following correction strategies. A short-term correction is to reduce rice production quantity. Due to the government's rice pledging policy rice quantity has raised to high level. Some long term corrections are to increase selling price, expand foreign markets and stress better rice quality.