

บทที่ 1

บทนำ

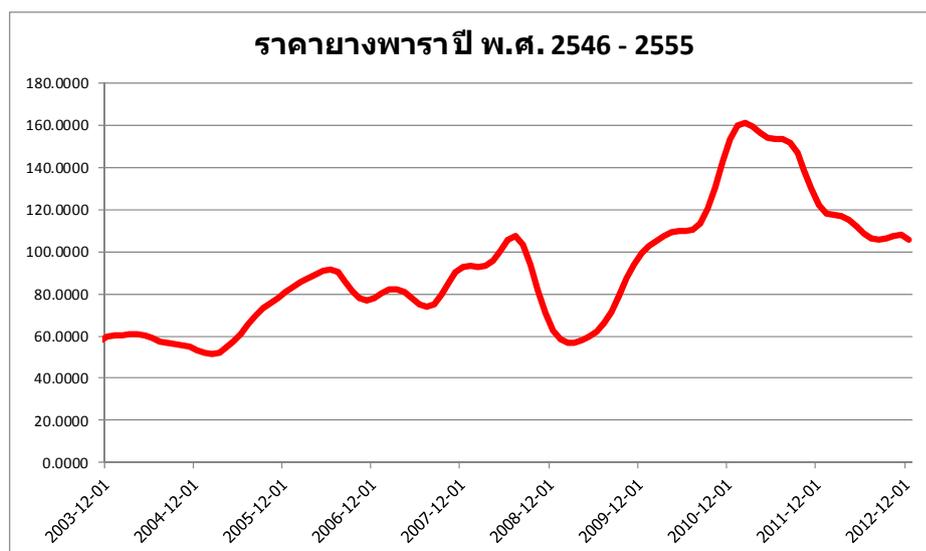
1.1 ความสำคัญและความเป็นมาของปัญหา

ยางพาราเป็นพืชเศรษฐกิจหลักที่สำคัญที่นำรายได้เข้าสู่ประเทศไทยเป็นจำนวนมากในแต่ละปี โดยประเทศไทยเป็นประเทศผู้ผลิตและส่งออกยางพาราเป็นอันดับหนึ่งของโลก เนื่องจากยางพาราใช้เป็นวัตถุดิบที่สำคัญในภาคการผลิตของอุตสาหกรรมต่าง ๆ ได้แก่ อุตสาหกรรมยานยนต์ และอุตสาหกรรมเครื่องใช้ในชีวิตประจำวัน เช่น ถุงมือยาง ถุงยางอนามัย ฯลฯ ทำให้ราคาของยางพาราเกิดความผันผวนขึ้นกรณี เศรษฐกิจโลกมีการเคลื่อนไหวแกว่งตัว เช่น เกิดการชะลอตัวของเศรษฐกิจโลก เนื่องจากปัญหาวิกฤตเศรษฐกิจของประเทศสหรัฐอเมริกา ส่งผลให้ยอดการสั่งซื้อรถยนต์ของแต่ละประเทศลดลง ทำให้ความต้องการในการใช้ยางพาราเพื่อนำไปผลิตยางรถยนต์ลดลง จึงมีการนำเข้ายางพาราน้อยลง ทำให้ราคาของยางพาราในช่วงดังกล่าวปรับตัวลดลงอย่างเห็นได้ชัด หรือในกรณีที่เศรษฐกิจโลกเข้าสู่ภาวะเฟื่องฟู ทำให้ประชาชนมีชีวิตความเป็นอยู่ที่ดี เกิดการจับจ่ายใช้สอยสะดวก ส่งผลให้ยอดการสั่งซื้อรถยนต์ของแต่ละประเทศเพิ่มขึ้น ทำให้ความต้องการในการใช้ยางพาราเพื่อนำไปผลิตยางรถยนต์เพิ่มขึ้น จึงทำให้ราคายางพาราปรับตัวสูงขึ้น เป็นต้น

ประเทศไทยได้ให้ความสำคัญเกี่ยวกับเรื่องความผันผวนของราคายางพารา จึงได้มีการจัดตั้งตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้า หรือ AFET ขึ้น โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อใช้เป็นเครื่องมือในการบริหารจัดการความเสี่ยงที่เกิดจากความผันผวนของราคาสินค้าเกษตร โดยเฉพาะยางพารา และใช้เป็นช่องทางในการเก็งกำไรของนักเก็งกำไรจากความผันผวนของราคาสินค้าเกษตรที่เกิดขึ้น

เนื่องจากตลาด AFET เป็นตลาดซื้อขายล่วงหน้า (Future Market) ระยะยาว ที่มีวัตถุประสงค์ของการซื้อขายแบบเก็งกำไร ไม่ได้เน้นการส่งมอบจริง และเป็นการซื้อขายสินค้าเกษตรหลายชนิด ทำให้ไม่เกิดประโยชน์โดยตรงต่อเกษตรกรผู้ผลิตยางพารารายย่อย ได้แก่ เกษตรกรชาวสวนยางที่ปลูกยางพาราและแปรรูปยางขายเอง ซึ่งมีต้นทุนในการผลิตต่ำ จึงได้เกิดแนวคิดของวิธีการซื้อขายยางพาราแบบตลาดข้อตกลง (Forward Market) โดย สถาบันวิจัยยาง กรมวิชาการเกษตร กระทรวงเกษตรและสหกรณ์ ได้จัดทำการซื้อขายยางพาราแบบตลาดข้อตกลงส่งมอบจริงขึ้นที่สำนักงานตลาดกลางยางพารานครศรีธรรมราช โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อใช้เป็น

ช่องทางในการประกันความเสี่ยงที่เกิดจากความผันผวนของราคายางพาราที่มีการขึ้นลงอย่างกะทันหันในตลาดปัจจุบัน (Spot Market) ลักษณะของตลาดข้อตกลงส่งมอบจริงคือเป็นการซื้อขายยางแผ่นรมควันชั้น 3 หรือ RSS3 แบบตลาดซื้อขายล่วงหน้าระยะสั้น ที่เน้นการส่งมอบจริง จึงทำให้เกิดประโยชน์โดยตรงต่อเกษตรกรผู้ผลิตยางพารารายย่อยและสหกรณ์ผู้ผลิตยาง ช่วยลดความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากปัจจัยต่าง ๆ ที่สำคัญต่อเศรษฐกิจโลก ซึ่งส่งผลกระทบต่อราคายางพารา ได้แก่ ภาวะเศรษฐกิจโลกในขณะนั้น สต็อกยางคงเหลือของโลก ราคาน้ำมันดิบในตลาดโลกและราคายางสังเคราะห์ อัตราการแลกเปลี่ยนเงินตราระหว่างประเทศ ภัยธรรมชาติที่เกิดขึ้นกับประเทศผู้ผลิตและประเทศนำเข้ายางพาราที่สำคัญ ๆ ฯลฯ ช่วยให้เกษตรกรผู้ผลิตยางพารารายย่อยและสหกรณ์ผู้ผลิตยาง ได้ทราบถึงแนวโน้มของปริมาณความต้องการใช้ยางพาราของโลก และราคาของยางพาราที่จะเกิดขึ้นในอนาคต เพื่อนำข้อมูลที่ได้รับไปวางแผนการผลิตและวางแผนการขายต่อไป โดยสามารถแสดงความผันผวนของราคายางพารา ได้ดังภาพที่ 1.1



ภาพที่ 1.1 ความผันผวนของราคายางพาราในปี พ.ศ. 2546 – 2555

1.2 ปัญหาวิจัย

ขั้นตอนการทำงานของตลาดข้อตกลงส่งมอบจริง ของสำนักงานตลาดกลางยางพารา นครศรีธรรมราชเป็นการซื้อขายยางพาราล่วงหน้าระยะสั้น ที่เน้นการส่งมอบจริง ซึ่งการที่ผู้ซื้อและผู้ขาย จะเข้ามาทำการซื้อขายยางพาราในตลาดข้อตกลงส่งมอบจริงได้นั้น จำเป็นต้องมีความรอบรู้ในเรื่องปัจจัยต่าง ๆ ที่มีความสำคัญต่อเศรษฐกิจโลกซึ่งจะส่งผลกระทบต่อราคายางพารา เช่น ภาวะเศรษฐกิจโลกในขณะนั้น สต็อกยางคงเหลือของโลก ราคาน้ำมันดิบในตลาดโลกและราคายางสังเคราะห์ อัตราการแลกเปลี่ยนเงินตราระหว่างประเทศ และภัยธรรมชาติต่าง ๆ ที่เกิดขึ้น ฯลฯ

เนื่องจากปัจจัยต่าง ๆ ข้างต้นที่ส่งผลกระทบต่อราคายางพาราเป็นสิ่งจำเป็นที่ผู้ซื้อและผู้ขายต้องรับรู้อย่างละเอียดเพื่อให้สามารถวิเคราะห์สถานการณ์ของราคายางพาราได้ จึงส่งผลกระทบต่อผู้ขายที่เป็นเกษตรกรรายย่อยซึ่งเป็นชาวสวนยางที่ผลิตยางพาราขายเอง และไม่มี ความรอบรู้ในเรื่องเศรษฐกิจโลกดังกล่าว อย่างไรก็ตาม ระบบของตลาดข้อตกลงส่งมอบจริง ของสำนักงานตลาดกลางยางพาราฯ ยังไม่มีการแจ้งเตือนเกี่ยวกับแนวโน้มของราคายางพาราที่อาจเกิดขึ้นในอนาคต ให้เกษตรกรเหล่านี้ได้รับทราบเพื่อใช้เป็นเครื่องมือช่วยในการตัดสินใจ

ผู้วิจัยจึงสนใจศึกษาเพิ่มเติมในส่วนของระบบการวิเคราะห์สถานการณ์ราคายางพารา โดยใช้แบบจำลองสัญญาณเตือนภัยล่วงหน้าราคายาง และแสดงผลการแจ้งเตือนในหน้าเว็บไซต์ของตลาดข้อตกลงส่งมอบจริง เพื่อใช้เป็นเครื่องมือในการแจ้งเตือนให้ผู้ซื้อ ผู้ขาย และผู้ที่เกี่ยวข้องกับตลาด ได้ทราบข้อมูลและนำข้อมูลที่ได้รับไปวางแผนการผลิตและวางแผนการซื้อขายต่อไปได้ ก่อนที่จะทำการซื้อขายกันในตลาดข้อตกลงส่งมอบจริง เพื่อให้เกิดประโยชน์แก่ทั้งสองฝ่าย

1.3 วัตถุประสงค์

1. เพื่อพัฒนาระบบการวิเคราะห์สถานการณ์ราคายางพารา โดยใช้แบบจำลองสัญญาณเตือนภัยล่วงหน้าราคายาง และแสดงผลการแจ้งเตือนในหน้าเว็บไซต์ของตลาดข้อตกลงส่งมอบจริง ของสำนักงานตลาดกลางยางพารา นครศรีธรรมราช เพื่อใช้เป็นเครื่องมือในการแจ้งเตือนเกี่ยวกับแนวโน้มของราคายางพาราที่อาจเกิดขึ้นในอนาคต ให้ผู้ซื้อ ผู้ขาย และผู้ที่เกี่ยวข้องกับตลาดได้นำข้อมูลไปใช้ประโยชน์ต่อไป

2. เพื่อทดสอบและประเมินผลประสิทธิภาพของระบบที่พัฒนาขึ้น

1.4 ขอบเขตของการวิจัย

1. ข้อมูลที่ใช้ในการวิจัยประกอบด้วยข้อมูลอนุกรมเวลารายเดือนที่เก็บรวบรวมไว้ของสถาบันวิจัยทาง กรมวิชาการเกษตร กระทรวงเกษตรและสหกรณ์ โดยใช้ข้อมูลราคาขายแผ่นรมควันชั้น 3 (RSS3) จากตลาดล่วงหน้าของโลก 3 ตลาด คือตลาดล่วงหน้าสิงคโปร์ (SICOM) โตเกียว (TOCOM) และเซี่ยงไฮ้ (SHFE) เป็นตัวแทนราคาขายในตลาดโลก (PW) ปริมาณความต้องการใช้ยางของโลก (DNR) ปริมาณการผลิตยางของโลก (SNR) สต็อกยางคงเหลือสิ้นเดือนของโลก (STOCK) ดัชนีผู้จัดการฝ่ายจัดซื้อ (Purchasing Managers Index : PMI) ของประเทศผู้ขาย ซึ่งจะใช้ดัชนี PMI จากประเทศญี่ปุ่น (PMI_JA) และดัชนี PMI จากประเทศจีน (PMI_CH) ข้อมูลทั้งหมดมีการเก็บรวบรวมไว้ตั้งแต่เดือนมกราคม 2545 ถึงธันวาคม 2555 รวม 132 ตัวอย่าง

2. นำข้อมูลอนุกรมเวลารายเดือนทั้งหมดที่เก็บรวบรวมไว้ มาทำการวิเคราะห์ข้อมูลเพื่อใช้กับแบบจำลองสัญญาณเดือนภัยล่วงหน้าราคาขาย โดยแบบจำลองฯ สามารถพยากรณ์ราคาขยาล่วงหน้าได้เป็นระยะเวลาหนึ่งเดือน

3. พัฒนาระบบการวิเคราะห์สถานการณ์ราคาขยาลพารา ในรูปแบบของเว็บแอปพลิเคชัน เพื่อแสดงผลการแจ้งเตือนในหน้าเว็บไซต์ ประกอบด้วย

3.1 การทำงานในส่วนของผู้ดูแลระบบ

3.2 การทำงานในส่วนของผู้ใช้งานระบบ

1.5 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ

ได้ระบบสารสนเทศของตลาดข้อตกลงส่งมอบจริง ของสำนักงานตลาดกลางยางพารานครศรีธรรมราช ที่สามารถวิเคราะห์สถานการณ์ราคาขยาลพาราได้ว่าราคาในอนาคตจะเป็นไปในทิศทางใด และสามารถแจ้งเตือนเกี่ยวกับแนวโน้มของราคาขยาลพาราที่อาจเกิดขึ้นในอนาคต ทำให้ผู้ซื้อ ผู้ขาย และผู้ที่เกี่ยวข้องกับตลาด มีเครื่องมือช่วยในการตัดสินใจก่อนทำการซื้อขายกัน ก่อให้เกิดประโยชน์ ดังนี้

ผู้ซื้อ สามารถทราบปริมาณวัตถุดิบที่แน่นอน ทำให้ช่วยประกันความเสี่ยงด้านต้นทุน และสามารถบริหารจัดการด้านการผลิตเพื่อส่งมอบสินค้าให้แก่ลูกค้าได้ตามกำหนด

ผู้ขาย สามารถวางแผนการผลิตและการจัดหาวัตถุดิบได้ และสามารถวางแผนและบริหารสัดส่วนการขายผลผลิตในตลาดซื้อขายแบบตลาดข้อตกลงส่งมอบจริง และตลาดปัจจุบันได้

1.6 นิยามศัพท์เฉพาะ

ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้า คือ ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย (Agricultural Futures Exchange of Thailand : AFET) ที่จัดตั้งขึ้นภายใต้พระราชบัญญัติการซื้อขายสินค้าเกษตรล่วงหน้า พ.ศ. 2542 ทำหน้าที่เป็นศูนย์กลางในการซื้อขายสินค้าเกษตรล่วงหน้าภายใต้กฎระเบียบที่ชัดเจนและเป็นธรรมแก่ผู้ซื้อและผู้ขาย โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อเป็นเครื่องมือและกลไกให้แก่ผู้ที่เกี่ยวข้องนำไปใช้บริหารจัดการความเสี่ยงด้านราคาสินค้าเกษตรที่อาจเกิดความผันผวนขึ้นในอนาคต และยังสามารถใช้เป็นช่องทางในการเก็งกำไรของนักลงทุนจากความผันผวนของราคาสินค้าเกษตรได้อีกด้วย

ตลาดซื้อขายล่วงหน้า (Future Market) คือ ตลาดซื้อขายสินค้าเกษตรล่วงหน้า ที่มีการทำสัญญากันในปัจจุบัน ระหว่างผู้ซื้อและผู้ขายว่าจะทำการซื้อขายสินค้าเกษตรกัน และจะส่งมอบรับมอบสินค้ากันในอนาคต ซึ่งจะระบุประเภทสินค้า ราคา และเวลาที่จะส่งมอบสินค้า มีข้อดีคือสินค้าเกษตรที่ทำการซื้อขายกันเป็นสินค้าที่มีคุณภาพเนื่องจากการกำหนดให้เป็นมาตรฐานเดียวกัน และช่วยลดความเสี่ยงด้านราคาสินค้าเกษตรที่อาจเกิดความผันผวนได้ในอนาคต อีกทั้งสัญญาซื้อขายล่วงหน้ายังสามารถเปลี่ยนมือได้ช่วยให้ผู้ซื้อและผู้ขายไม่ต้องผูกพันกันไปจนถึงวันครบกำหนดส่งมอบสัญญา

ตลาดซื้อตกลง (Forward Market) คือ ตลาดซื้อขายสินค้าเกษตรที่มีการทำสัญญาซื้อตกลงกัน โดยถือเป็นสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภทหนึ่ง ต่างกันตรงที่คู่สัญญาต้องผูกพันกันไปจนถึงวันส่งมอบรับมอบสินค้า

ตลาดซื้อตกลงส่งมอบจริง ของสำนักงานตลาดกลางยางพารา นครศรีธรรมราช คือ ตลาดซื้อขายยางแผ่นรมควันชั้น 3 หรือ RSS3 ล่วงหน้าระยะสั้น มีรอบการซื้อขาย 7 วัน

ตลาดปัจจุบัน (Spot Market) คือ ตลาดซื้อขายสินค้าเกษตรที่มีการตกลงส่งมอบรับมอบสินค้าและชำระเงินกันในทันที

ผู้ซื้อ คือ โรงงาน บริษัท หรือสถาบันเกษตรกร ที่ได้รับมาตรฐาน GMP จากสถาบันวิจัยยาง และต้องเป็นสมาชิกผู้ประมูลยางของตลาดกลางยางพารา นครศรีธรรมราช

ผู้ขาย คือ เกษตรกรและสหกรณ์ผู้ผลิตยาง โดยต้องเป็นสมาชิกผู้ขายยางแผ่นรมควันชั้น 3 ของตลาดกลางยางพารา นครศรีธรรมราชไม่ต่ำกว่า 6 เดือน และต้องผ่านการประเมินศักยภาพด้านกระบวนการผลิต คุณภาพยาง และการบริหารจัดการ