

## บทที่ 2

### แนวคิดทฤษฎีและวรรณกรรมปริทัศน์

#### แนวคิดทฤษฎี

#### 2.1 ทฤษฎีโครงสร้าง พฤติกรรมและผลการดำเนินงาน (Structure Conduct and Performance)

##### 2.1.1 ทฤษฎีโครงสร้างตลาด

เนื่องจากตลาดต่างๆ เช่น ตลาดแข่งขันสมบูรณ์ (Perfect Competition) ตลาดผูกขาด (Monopoly) หรือตลาดผู้ขายน้อยราย (Oligopoly) เป็นต้น จะมีโครงสร้างตลาดที่แตกต่างกันไป เช่นตลาดผูกขาดจะมีกำไรส่วนเกิน (Surplus) สูงกว่าตลาดแข่งขันสมบูรณ์ และตลาดผู้ขายน้อยราย การศึกษาถึงโครงสร้างตลาดจะเป็นประโยชน์ต่อการทราบถึงพฤติกรรมของหน่วยผลิตและอุตสาหกรรมนั้นๆ ในโลกแห่งความเป็นจริงระบบเศรษฐกิจและระบบตลาดมีความยุ่งยากและซับซ้อนมาก ดังนั้นการแบ่งแยกประเภทของตลาดว่าควรอยู่ตรงไหนจึงเป็นไปได้ยาก ทั้งนี้เพราะการกำหนดขอบเขตของตลาดว่าควรอยู่ตรงไหนค่อนข้างคลุมเครือและมีข้อโต้แย้งได้เสมอ ดังนั้นในทางปฏิบัติที่จะบอกว่าตลาดสินค้านี้เป็นตลาดแข่งขันสมบูรณ์หรือมีผู้ขายน้อยรายหรือผูกขาด สมบูรณ์ จึงแตกต่างกันไปตามเงื่อนไขและกฎเกณฑ์ที่แต่ละคนกำหนด อย่างไรก็ตามเรามีบรรทัดฐานที่วัดได้ว่าตลาดที่ปลายด้านหนึ่งเป็นตลาดแข่งขันสมบูรณ์ และระดับของการผูกขาดจะเพิ่มขึ้นเรื่อยๆจนมาถึงสุดปลายอีกด้านหนึ่งที่มีการผูกขาดสมบูรณ์อย่างเต็มที่ โครงสร้างตลาดทั้งสองนี้บอกไว้อย่างชัดเจน แต่ในระหว่างโครงสร้างตลาดทั้งสองปลายขั้วนี้คือตลาดกึ่งแข่งขันกึ่งผูกขาดไปเรื่อยๆจนถึงตลาดผู้ขายน้อยราย การจะชี้เฉพาะเจาะจงว่าเส้นแบ่งเขตอยู่ตรงไหนนั้นไม่ชัดเจนนัก ดังนั้นในทางปฏิบัติการนิยามตลาดที่อยู่ระหว่างตลาดที่ปลายขั้วทั้งสองนี้จะพิจารณาถึงปัจจัยแต่ละตัวที่ประกอบขึ้นเป็นโครงสร้างตลาดได้แก่ จำนวนผู้ขาย และลักษณะการกระจายของขนาดการผลิต ทั้งนี้เพราะการดูแต่จำนวนผู้ขายอย่างเดียวไม่เพียงพอที่จะบอกได้ว่าตลาดเป็นเช่นไร ขนาดของหน่วยผลิตแต่ละหน่วยที่ประกอบขึ้นเป็นตลาดมีส่วนสำคัญในการวิเคราะห์ด้วย ตัวอย่างเช่น ถ้าในตลาดมีผู้ขายอยู่จำนวน 250 ราย แต่ละรายมีขนาดการผลิตที่เท่าๆกัน เปรียบกับตลาดเดียวกันนี้มีผู้ประกอบการด้วยผู้ผลิต 250 รายเช่นเดียวกัน แต่มีผู้ผลิตรายใหญ่อยู่เพียง 4-5 ราย ในขณะที่หน่วยผลิตอื่นๆล้วนมีขนาดเล็ก ในกรณีเช่นนี้เราจะบอกได้ทันทีว่าตลาดทั้งสองไม่ใช่ตลาดเดียวกัน ดังนั้นเราสามารถสรุปได้ว่าจำนวนผู้ผลิตและลักษณะการกระจายของขนาดผู้

ผลิตจะทำให้เราทราบถึงอำนาจเหนือตลาด (Market Power) ของผู้ผลิตในตลาดนั้นๆ ในกรณีของตลาดผูกขาด อำนาจเหนือตลาดจะอยู่ที่ผู้ผลิตที่หน่วยผลิตหน่วยเดียวในตลาด แต่เมื่อผู้ผลิตมีจำนวนมากขึ้นอำนาจผูกขาดของผู้ผลิตแต่ละหน่วยย่อมน้อยลง ตามจำนวนหน่วยผลิตที่เพิ่มมากขึ้นอย่างไรก็ตามถ้าจำนวนหน่วยผลิตที่เพิ่มขึ้นเป็นหน่วยผลิตที่มีขนาดเล็กๆเมื่อเปรียบเทียบหน่วยผลิตเดิมที่มีอยู่ อำนาจผูกขาดของหน่วยผลิตเดิมก็ยังคงมีอยู่ แม้ว่าจะลดลงบ้าง ดังนั้นจำนวนหน่วยผลิตและลักษณะการกระจายของขนาดของหน่วยการผลิตจะเป็นตัวชี้ตัวหนึ่งที่บอกระดับอำนาจการตลาดหรืออำนาจผูกขาดของผู้ผลิตได้ ซึ่งการวัดอำนาจทางตลาดของหน่วยผลิตนี้สามารถทำได้โดยวัดการกระจุกตัว ซึ่งการวัดการกระจุกตัวนี้จะแบ่งการวัดออกเป็น 2 ลักษณะ (Waterson,1984) คือ

2.1.1.1 การวัดการกระจุกตัวเพียงบางส่วน (Partial Concentration)

2.1.1.2 การวัดการกระจุกตัวโดยรวม (Summary Index)

#### 2.1.1.1 การวัดการกระจุกตัวเพียงบางส่วน (Partial Concentration)

เป็นการวัดการกระจุกตัวที่พิจารณาถึงจำนวนหน่วยผลิตบางส่วนในตลาด กล่าวคือ จะไม่นำหน่วยผลิตทั้งหมดในตลาดมาคำนวณ แต่จะใช้หน่วยผลิตใหญ่ๆเพียงบางส่วนในตลาดเท่านั้นมาพิจารณา เพราะว่า จะให้ความสำคัญกับหน่วยผลิตใหญ่ๆ และอาจจะไม่ทราบจำนวนหน่วยผลิตทั้งหมดในอุตสาหกรรม ดัชนีวัดการกระจุกตัวบางส่วนนี้จะบอกเราให้ทราบถึงเปอร์เซ็นต์ของมูลค่าตัวแปรบางอย่าง เช่นจำนวนมูลค่าเพิ่ม จำนวนการจ้างงาน ทรัพย์สิน หรือส่วนแบ่งการตลาดที่หน่วยผลิตส่วนหนึ่งถือครองอยู่ ซึ่งเมื่อรวมกันแล้วเป็นจำนวนมากกว่าหน่วยผลิตอื่นๆในตลาด หน่วยผลิตบางส่วนที่กล่าวนี้อาจจะเป็นหน่วยผลิตใหญ่เพียง 4 รายแรกรวมกัน หรือ 8 รายแรกรวมกันก็ได้ดังนั้นตัวเลขการกระจุกตัวที่วัดได้จึงหมายถึง ผู้ผลิตจำนวนน้อยราย (4 ,8, 10 หรือ ฯลฯ) ในตลาดซึ่งมีความสามารถที่จะมีส่วนแบ่งเป็นจำนวนเท่าใดถ้าการกระจุกตัวยิ่งสูง ก็แสดงว่าจำนวนส่วนแบ่งของผู้ผลิตน้อยรายในตลาดนี้ยิ่งมากกว่าหน่วยผลิตที่เหลืออื่นๆ โดยเปรียบเทียบ ยกตัวอย่างเช่น  $CR_4 = 60$  ก็หมายความว่าอัตราการกระจุกตัวของ 4 หน่วยผลิตแรกในตลาดสามารถมีอำนาจเหนือตลาด (เช่น มีส่วนแบ่งในการขาย หรือส่วนแบ่งในทรัพย์สิน หรือส่วนแบ่งในการจ้างงาน) สูงถึง 60 เปอร์เซ็นต์

วิธีวัดการกระจุกตัวเพียงบางส่วนมีมากมายหลายวิธี และแต่ละวิธีมีข้อดีข้อเสียแตกต่างกัน ในที่นี้จะกล่าวถึงวิธีที่นิยมใช้กันอย่างแพร่หลาย ได้แก่ วิธีการวัด Concentration Ratio ( $CR_n$ )

#### - วิธีการวัด Concentration Ratio ( $CR_n$ )

การวัดวิธีนี้เป็นการวัดอัตราส่วนการกระจุกเพียงบางส่วน ซึ่งอัตราส่วนการกระจุกตัวจะคำนวณได้จากสูตรข้างล่างนี้

$$CR_n = \sum S_i = \sum Y_i / N \quad \text{---(2.1)}$$

โดยที่  $CR_n$  คือ อัตราส่วนการกระจุกตัวของ  $n$  หน่วยผลิต

$S_i$  คือ อัตราส่วนโดยเปรียบเทียบของแต่ละหน่วยผลิตซึ่งมีค่าเท่ากับ มูลค่าที่แต่ละหน่วยผลิตถือครอง ( $Y_i$ )/มูลค่าทั้งหมดของตลาด ( $Y$ )

อย่างไรก็ตามการวัดอัตราการกระจุกตัวแบบนี้มีข้อเสียคือ

- ก) บอกรวมการกระจุกตัวของหน่วยผลิตเพียงบางหน่วย แต่ไม่ได้บอกพฤติกรรมบางอย่างของหน่วยผลิต
- ข) ไม่ได้ให้ข้อมูลเกี่ยวกับขนาดโดยเปรียบเทียบ (Relative Size) และตำแหน่งของหน่วยในกลุ่ม
- ค) ไม่ได้บอกรวมถึงการเปลี่ยนตำแหน่งของหน่วยผลิตในตลาด และไม่ได้อธิบายถึงการกระจายของจำนวนและขนาดทั้งหมดของหน่วยผลิตในตลาดนั้นๆ

#### 2.1.1.2 การวัดการกระจุกตัวโดยรวม (Summary Index)

การวัดการกระจุกแบบนี้จะพิจารณาถึงหน่วยผลิตทั้งหมดในตลาด ซึ่งจะศึกษาถึงความเท่าเทียมกันหรือความไม่เท่าเทียมกันของการกระจายของขนาดหน่วยผลิตในตลาดดังกล่าว วิธีวัดการกระจุกตัวโดยรวมที่นิยมก็คือ

- ดัชนีเฮอฟินดัล (Herfindahl Summary Index)

ซึ่งคำนวณได้จาก

$$H = \sum S_i^2 = \sum (Y_i / Y)^2 \quad \text{---(2.2)}$$

$S_i$  คืออัตราส่วนโดยเปรียบเทียบของแต่ละหน่วยผลิต ซึ่งมีค่าเท่ากับ

มูลค่าที่แต่ละหน่วยผลิตถือครอง ( $Y_i$ ) / มูลค่าทั้งหมดของตลาด( $Y$ )

การวัดดัชนีเฮอฟินดัล นี้เป็นการวัดแบบรวมหน่วยผลิตทั้งหมดในตลาด และค่าของ  $H$  จะมีค่าอยู่ระหว่าง 1 และ  $1/n$  นั่นคือ  $1/n < H < 1$  ในกรณีที่หน่วยผลิตมีเพียงหน่วยเดียวในตลาด ค่า  $H = 1$  ซึ่งหมายถึงตลาดเป็นแบบผูกขาด (Monopoly)

- Theil's Method หรือ Entropy Index (E)

Theil (1967) ได้เสนอการวัดการกระจุกตัวของ อุตสาหกรรมในแบบ Entropy ซึ่งมีรูปแบบการวัดค่าคือ ค่าของการถ่วงน้ำหนักเฉลี่ย Logarithm ด้วยส่วนแบ่งของธุรกิจแต่ละแห่งในอุตสาหกรรมนั่นเอง โดยคำนวณได้จากสูตรดังนี้

$$E = - \sum S_i \log S_i \quad \text{---(2.3)}$$

$S_i$  คืออัตราส่วนโดยเปรียบเทียบของแต่ละหน่วยผลิต ซึ่งมีค่าเท่ากับมูลค่าที่แต่ละหน่วยผลิตถือครอง ( $Y_i$ ) / มูลค่าทั้งหมดของตลาด( $Y$ )

ค่า Entropy จะไม่เป็นลบโดย  $E$  จะมีค่าเข้าใกล้ 0 ซึ่งเป็นค่าต่ำสุดเมื่อหน่วยผลิตทุกหน่วยในตลาดมีขนาดไม่เท่ากัน ซึ่งแสดงว่าตลาดมีการผูกขาด เมื่อ  $E = 0$  แสดงว่าอุตสาหกรรมมีการผูกขาดโดยหน่วยผลิตรายเดียว และ  $E$  จะมีค่าสูงสุดเมื่อ  $S_i = 1/n$  ดังนั้น  $E = -n \cdot (1/n) \cdot \log(1/n) = \log n$  ซึ่งแสดงว่าหน่วยผลิตทุกหน่วยมีขนาดหรือส่วนแบ่งตลาดเท่ากันหมด นั่นคือตลาดมีการแข่งขันสมบูรณ์

## 2.1.2 ทฤษฎีพฤติกรรมกรรมการตลาด

พฤติกรรมกรรมการตลาดหมายถึง นโยบายของธุรกิจที่มีต่อตลาดสินค้าของตนและต่อคู่แข่งชั้น ตามทฤษฎีเศรษฐศาสตร์ อุตสาหกรรมแต่ละประเภทมีรูปแบบของพฤติกรรมที่แตกต่างกันไปซึ่งขึ้นอยู่กับลักษณะโครงสร้างตลาด ในบางอุตสาหกรรมธุรกิจอาจไม่มีเสรีภาพในการประกอบการ ในขณะที่อุตสาหกรรมอื่นทำได้เต็มที่

พฤติกรรมที่แข่งขันของผู้ผลิตในอุตสาหกรรมต่างๆแบ่งได้ออกเป็น 2 ชนิด คือ

### 2.1.2.1 พฤติกรรมการแข่งขันที่ใช้ราคา

### 2.1.2.2 พฤติกรรมการแข่งขันที่มีใช้ราคา

#### 2.1.2.1 พฤติกรรมการแข่งขันที่ใช้ราคา

พฤติกรรมการแข่งขันที่ใช้ราคาในอุตสาหกรรมนี้ผู้ผลิตจะใช้เครื่องมือ 3 ชนิดคือ ราคาสินค้า ราคาขนส่ง และส่วนลด โดยผู้ผลิตมีจุดประสงค์ที่จะเพิ่มส่วนแบ่งการตลาด หรือเพิ่มยอดขายให้กับบริษัท แต่พฤติกรรมดังกล่าวมักไม่นิยมทำกันในอุตสาหกรรมที่มีผู้ผลิตน้อยราย เนื่องจากการขึ้นต่อกันของผู้ผลิต และการที่ข้อมูลข่าวสารทั่วถึงกันหมด บางครั้งการใช้ราคาในการแข่งขัน อาจจะถูกคู่แข่งตอบโต้โดยลดราคาตามลงมาบ้าง ซึ่งถ้าไม่มีการหยุดหันมาปรึกษาร่วมมือกันจะเกิดสงครามราคา (Price War) ในที่สุด

#### 2.1.2.2 พฤติกรรมการแข่งขันที่มีใช้ราคา

ในตลาดผู้ขายน้อยราย ผู้ผลิตจะตระหนักในการขึ้นอยู่ต่อกัน ผู้ผลิตจึงมีแนวโน้มที่จะหันมาใช้การแข่งขันที่มีใช้ราคาแทน ซึ่งสามารถแบ่งแยกออกเป็น 3 ลักษณะ(นราทิพย์ ชุตินวงศ์, 2538: 347-348) คือ

- การทำให้ผลิตภัณฑ์แตกต่างจากคู่แข่ง (Product Differentiation) คือการทำให้ผลิตภัณฑ์มีความแตกต่างจากสินค้าของคู่แข่ง ซึ่งอาจอยู่ในรูปของ ขนาด สี และ หีบห่อ การวางตำแหน่งของผลิตภัณฑ์ว่าเป็นสินค้าระดับใด หรือ การค้นคว้า ผลิตภัณฑ์ใหม่

- การเลือกช่องทางการจัดจำหน่าย (Channel of Distribution) นับว่าเป็นสิ่งสำคัญมากต่อผู้ผลิต เพราะเป็นการผ่านสินค้าจากผู้ผลิตไปยังผู้บริโภค ซึ่งหากบริษัทใดมีช่องทางการจัดจำหน่ายที่ดี ก็จะสามารถทำให้ผลิตภัณฑ์ติดตลาดได้ไม่ยาก ดังนั้นผู้ผลิตจึงต้องพิจารณาให้ดีในการที่จะเลือกช่องทางการตลาดแบบใดหรือให้ความสำคัญกับช่องทางการจำหน่ายแบบใดมากที่สุด เช่น การจำหน่ายโดยผู้แทนจำหน่าย การจำหน่ายโดยบริษัทโดยตรง
- การส่งเสริมการตลาด (Promotion) เป็นการส่งเสริมให้ผลิตภัณฑ์เป็นที่รู้จักและยอมรับจากผู้บริโภค มีเครื่องมือที่ใช้คือ การสาธิตสินค้า การจัดสัมมนา ฝึกอบรมและพาชมโรงงาน การให้รางวัลตามยอดขาย การให้รางวัลแก่พนักงานขายหน้าร้าน การลด/แจก/แถม/จับสลากของรางวัล การจัดหน่วยบริการทางเทคนิค การเปิดศูนย์รับข้อร้องเรียนปัญหาลูกค้า การโฆษณาสินค้าและภาพพจน์องค์กรผ่านสื่อมวลชน การพาลูกค้าตัวแทนจำหน่ายไปท่องเที่ยวต่างประเทศ/ในประเทศ การชักจูงผู้ใช้เองทางจดหมาย

### 2.1.3 ทฤษฎีผลการดำเนินงานของตลาด

หมายถึงผลพวงทางเศรษฐกิจจากอุตสาหกรรมซึ่งได้มาจากผลรวมของหน่วยธุรกิจทั้งหมดในอุตสาหกรรมนั้น และมีผลกระทบต่อสังคมในที่สุด Bain (1959) ได้กล่าวถึงผลการดำเนินงานในด้านต่างๆ ว่ามีดังนี้

2.1.3.1 ดีกรีความแตกต่างระหว่างราคากับทุน

2.1.3.2 ประสิทธิภาพเชิงเปรียบเทียบของการผลิตที่ได้รับอิทธิพลจากขนาดของโรงงานและหน่วยธุรกิจ และกำลังผลิตส่วนเกิน

2.1.3.3 ขนาดของค่าใช้จ่ายในการส่งเสริมการขาย โดยเปรียบเทียบกับต้นทุนการผลิตสินค้าหรือบริการของหน่วยธุรกิจ

2.1.3.4 ลักษณะของสินค้า การออกแบบ ระดับของคุณภาพ และความหลากหลายของสินค้าในตลาด

2.1.3.5 อัตราความก้าวหน้าของหน่วยธุรกิจและอุตสาหกรรมในการพัฒนาสินค้าและวิธีการผลิต โดยเปรียบเทียบกับต้นทุนของความก้าวหน้า

ผลการดำเนินงานข้างต้นนี้อาจกล่าวได้ว่าเป็นผลในด้านประสิทธิภาพ (Efficiency) ประสิทธิภาพการตลาดนี้แบ่งเป็นประสิทธิภาพราคา (Price Efficiency) ประสิทธิภาพการผลิต (Technical or Allocative Efficiency) และประสิทธิภาพรวม หรือประสิทธิภาพเศรษฐกิจ (Economic Efficiency) ซึ่งเป็นผลลัพธ์ของประสิทธิภาพสองอย่างแรก ความแตกต่างระหว่างราคากับต้นทุนในข้อ 1) และผลในข้อ 3) เป็นตัวอย่างของประสิทธิภาพราคา ส่วนข้ออื่นๆจัดได้ว่าเป็นประสิทธิภาพการผลิต นอกจากประสิทธิภาพการตลาดแล้วนักเศรษฐศาสตร์เกษตรยังได้หันไปพิจารณาผลการดำเนินงานในแง่มุมอื่นๆอีก เช่น ความมีเสถียรภาพของรายได้และการกระจายรายได้ การจ้างงาน การพัฒนาของอุตสาหกรรมอื่นๆที่เกี่ยวข้อง ความเพียงพอของอุปทานสินค้าและความสามารถในการปรับตัวต่อการเปลี่ยนแปลงของสภาวะเศรษฐกิจ เป็นต้น

การศึกษาประสิทธิภาพราคานี้มุ่งที่จะประเมินว่าราคาที่เกิดขึ้นในตลาดกับราคาที่เหมาะสมจะเป็นในตลาดที่มีประสิทธิภาพนั้นแตกต่างกันหรือไม่เพียงไร โดยอิงราคาในตลาดแข่งขันสมบูรณ์เป็นเกณฑ์ เราคาดว่าตลาดที่มีประสิทธิภาพนั้นจะสร้างราคาโดยมีความสัมพันธ์กับต้นทุนในการผลิตหรือประโยชน์ทั้งในด้านเวลา ระยะทางและรูปลักษณะพื้นฐาน เมื่อสินค้ามีการเก็บรักษา ราคาสินค้าก็ควรเป็นราคาของสินค้าบวกกับต้นทุนการเก็บรักษา หรือสินค้าที่ผ่านการแปรรูปก็ควรมีราคาเท่ากับวัตถุดิบบวกต้นทุนการแปรรูป และสินค้าที่ผ่านการขนส่งก็มีราคาเท่ากับต้นทุนการขนส่งบวกด้วยราคา สินค้าก่อนขนส่ง หากราคาต่างไปต่างแนวทางนี้กลไกราคาก็ขาดประสิทธิภาพ การวัดประสิทธิภาพของราคาของระบบตลาดจึงมักพิจารณาในแง่ของต้นทุนการตลาดเปรียบเทียบกับส่วนเหลือการตลาด ความสัมพันธ์ของการเปลี่ยนแปลงราคาในตลาดในระดับต่างๆ และส่วนแบ่งของเกษตรกร เป็นต้น (อารี วิบูลย์พงศ์, 2532: 29 – 31)

บริษัทแข่งขันสมบูรณ์เช่นเดียวกับบริษัทผูกขาด จะกำหนดระดับของผลิตเพื่อให้ได้กำไรสูงสุด เพราะว่าเส้นอุปสงค์ลาดลง ยิ่งบริษัทผูกขาดขายสินค้ามาก ราคายิ่งลดต่ำลงเนื่องจากการมีกำไร (Trade off) กั้นระหว่างราคาและปริมาณที่ถูกกำหนดจากเส้นอุปสงค์ บริษัทผูกขาดที่แสวงหากำไรสูงสุดสามารถตั้งราคาหรือปริมาณได้อย่างใดอย่างหนึ่งเท่านั้น ถ้าบริษัทผูกขาดกำหนดปริมาณ ราคาจะถูกกำหนดโดยเส้นอุปสงค์ในตลาด ในทางตรงกันข้ามถ้าบริษัทผูกขาดกำหนดราคา ปริมาณจะถูกกำหนดโดยเส้นอุปสงค์ในตลาด บริษัทผูกขาดจะได้กำไรสูงสุดเมื่อรายรับเพิ่มเท่ากับต้นทุนเพิ่ม ( $MR=MC$ ) ซึ่งในทางทฤษฎีแล้ว เงื่อนไขของกำไรสูงสุดสามารถแสดงได้ดังสมการที่ (2.4)

$$\frac{P^M - MC}{P^M} = -\frac{1}{\varepsilon} \quad \text{---(2.4)}$$

ทางซ้ายมือของสมการที่ (2.4) เป็นส่วนเหลือมราคาและต้นทุน (Price-Cost Margin) ซึ่งเป็นความแตกต่างระหว่างราคาและต้นทุนเพิ่มที่เป็นสัดส่วนต่อราคา ซึ่งจะขึ้นอยู่กับความยืดหยุ่นของอุปสงค์ที่บริษัทกำลังเผชิญอยู่ โดยส่วนเหลือมราคาและต้นทุนนี้เรียกว่า Lerner's Index ซึ่งเป็นดัชนีที่แสดงถึงอำนาจเหนือตลาด (Lerner, 1934) กล่าวคือเมื่ออุปสงค์มีความยืดหยุ่นมาก ราคาของบริษัทผูกขาดใกล้เคียงกับต้นทุนเพิ่ม สะท้อนให้เห็นว่าอำนาจตลาดมีน้อย ตลาดจึงมีลักษณะแข่งขันมากกว่า ในทางกลับกันหากอุปสงค์มีความยืดหยุ่นน้อย ราคาของบริษัทผูกขาดมากกว่าต้นทุนเพิ่ม สะท้อนให้เห็นว่าอำนาจตลาดมีมาก ตลาดจะมีลักษณะผูกขาดมากกว่า

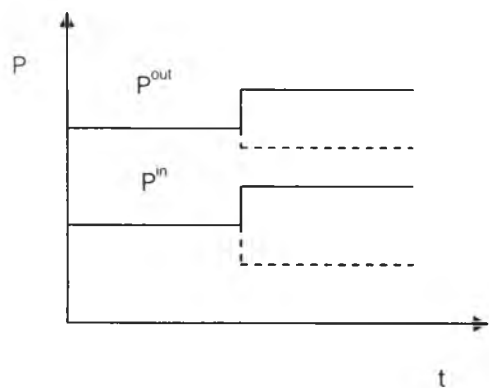
## 2.2 การส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตร (Asymmetric Price Transmission)

### 2.2.1 ประเภทของการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตร

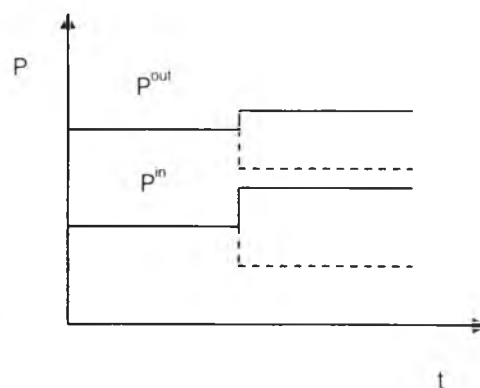
ตามทฤษฎีเศรษฐศาสตร์สำนักนีโอคลาสสิกนั้น กลไกราคาจะช่วยในการจัดสรรทรัพยากรได้อย่างมีประสิทธิภาพ โดยมีการส่งผ่านราคาที่เชื่อมตลาดทั้งในระดับเดียวกัน (Spatial Market) และต่างระดับ (Vertical Market) นักเศรษฐศาสตร์ที่ต้องการศึกษาประสิทธิภาพของตลาดจึงต้องสืบค้นกระบวนการส่งผ่านราคา

การศึกษาการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรจึงนับเป็นหัวข้อที่สำคัญหัวข้อหนึ่งในวิชาเศรษฐศาสตร์ เนื่องจากเหตุผล 2 ประการด้วยกัน กล่าวคือ 1) การส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรกัน อาจชี้ให้เห็นถึงกำไรส่วนเกินในทฤษฎีเศรษฐศาสตร์ ซึ่งสะท้อนถึงตลาดแข่งขันที่ไม่สมบูรณ์ และ 2) จากข้อแรก ปรากฏการณ์ความไม่สมมาตรของการส่งผ่านราคาสามารถใช้เป็นหลักฐานสำหรับภาครัฐในการกำหนดนโยบายเพื่อเข้าแทรกแซงตลาดได้ เพราะโดยทั่วไปแล้วปรากฏการณ์ดังกล่าวมักถูกสันนิษฐานว่าเกิดจากอำนาจเหนือตลาด (Von Cramon-Taubadel and Meyer, 2000: 1)



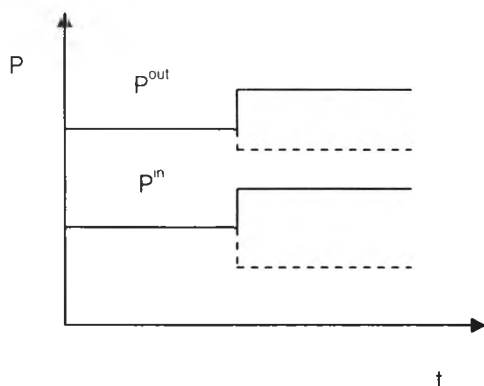


ภาพที่ 2.1a การส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรทางบวก

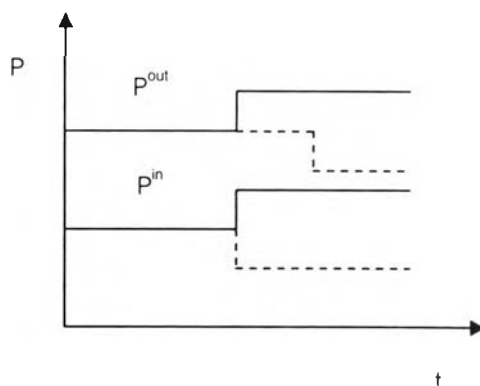


ภาพที่ 2.1b การส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรทางลบ

ใน Peltzman (2000) การส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรถูกแบ่งออกเป็น การส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรทางบวก (Positive Asymmetric) และ การส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรทางลบ (Negative Asymmetric) สำหรับการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรทางบวก (ดูภาพที่ 2.1a) เมื่อราคาต้นทุน ( $P^{\text{in}}$ ) เพิ่มขึ้น ราคาปลายทาง ( $P^{\text{out}}$ ) จะปรับตัวมากกว่า (ขนาด) หรือรวดเร็วกว่า (ความเร็ว) เมื่อเปรียบเทียบกับกรณีที่ราคาต้นทุนลดลง ส่งผลทำให้พ่อค้าได้รับกำไรจากส่วนต่างของราคาดังกล่าว ในทางตรงกันข้าม เมื่อราคาต้นทุน ( $P^{\text{in}}$ ) เพิ่มขึ้น หากราคาปลายทาง ( $P^{\text{out}}$ ) ปรับตัวน้อยกว่า (ขนาด) หรือช้ากว่า (ความเร็ว) ในกรณีที่ราคาต้นทุนลดลง เราจะเรียกว่า การส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรทางลบ (ดูภาพที่ 2.1b) ในกรณีนี้พ่อค้าจะขาดทุนจากส่วนต่างของราคาดังกล่าว



ภาพที่ 2.2a การส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตร (ขนาด)



ภาพที่ 2.2b การส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตร (ความเร็ว)

นอกจากการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรถูกแบ่งออกเป็นกรณีสองกรณีการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรทางบวกและการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรทางลบแล้ว การส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรยังสามารถแบ่งออกเป็นกรณีสองกรณีการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรเชิงขนาด (Magnitude) และการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรเชิงความเร็ว (Speed) ในกรณีการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรเชิงขนาด (รูปที่ 2.2a) เมื่อราคาต้นทุน ( $P^{\text{in}}$ ) เพิ่มขึ้นหรือลดลง ราคาปลายทาง ( $P^{\text{out}}$ ) ก็จะปรับตัวตามทันที แต่ขนาดการเปลี่ยนแปลงของราคาปลายทางจะน้อยกว่าขนาดของการเปลี่ยนแปลงราคาต้นทุน สำหรับในกรณีของการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรเชิงความเร็ว (รูปที่ 2.2b) เมื่อราคาต้นทุน ( $P^{\text{in}}$ ) เพิ่มขึ้นหรือลดลง ราคาปลายทาง ( $P^{\text{out}}$ ) จะไม่ปรับตัวตามทันที แต่ราคาปลายทางจะค่อยๆปรับตัวจนกว่าขนาดของการเปลี่ยนแปลงของราคาปลายทางจะเท่ากับขนาดของการเปลี่ยนแปลงราคาต้นทุน ทั้งนี้การส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรสามารถเกิดขึ้นทั้งในตลาดต่างระดับกัน (Vertical Market) และในตลาดเดียวกัน (Horizontal Market)

## 2.2.2 การวิเคราะห์การส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตร

Tweenten and Quance (1969) เป็นงานวิจัยทางด้านเศรษฐศาสตร์การเกษตรที่ใช้เทคนิคตัวแปรหุ่น (Dummy Variable) ในการประมาณ Irreversible Supply Functions ซึ่งต่อมาได้ถูกนำมาปรับใช้ในการวิเคราะห์การส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรดังสมการที่ (2.5)

$$P_t^{\text{out}} = \alpha + \beta_1^+ D_t^+ P_t^{\text{in}} + \beta_1^- D_t^- P_t^{\text{in}} + \varepsilon_t \quad \text{---(2.5)}$$

$D_t^+$  และ  $D_t^-$  เป็นตัวแปรหุ่นโดย  $D_t^+$  มีค่าเท่ากับ 1 ถ้า  $P_t^{\text{in}} \geq P_{t-1}^{\text{in}}$  และ  $D_t^+$  มีค่าเท่ากับ 0 ในกรณีอื่นๆ ในทางตรงกันข้าม  $D_t^-$  จะมีค่าเท่ากับ 1 ถ้า  $P_t^{\text{in}} < P_{t-1}^{\text{in}}$  และ  $D_t^-$  มีค่าเท่ากับ 0 ในกรณีอื่นๆ ด้วยการใช้ตัวแปรหุ่น ทำให้สามารถแยกราคาต้นทุนที่เป็นตัวแปรอิสระออกเป็นราคาต้นทุนที่กำลังปรับตัวสูงขึ้นและราคาต้นทุนที่กำลังปรับตัวลดลง โดยสัมประสิทธิ์ที่คำนวณได้จากสมการที่ (2.4) สามารถนำมาทดสอบว่ามีความแตกต่างกันหรือไม่ ด้วย F-test ซึ่งจะช่วยให้เห็นถึงการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรกันได้

ต่อมา Houck (1977) ได้ปรับปรุงวิธีการวิเคราะห์การส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรกันด้วยการทำ First Differences เพื่อแก้ไขปัญหาสหสัมพันธ์ของตัวรบกวน (Autocorrelation) ดังสมการที่ (2.6) และกลายเป็นวิธีการวิเคราะห์พื้นฐานเกี่ยวกับการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรกันที่มีผู้วิจัยนำไปปรับใช้ในงานวิจัยอีกหลายชิ้น (Kinnucan and Folker, 1987; Boyd and Brorsen, 1988; Bailey and Brorsen, 1989)

$$\Delta P_t^{\text{out}} = \alpha + \beta_1^+ D_t^+ \Delta P_t^{\text{in}} + \beta_1^- D_t^- \Delta P_t^{\text{in}} + \varepsilon_t \quad \text{---(2.6)}$$

เนื่องจากในสมการที่ (2.5) และ (2.6) นั้น Von Cramon-Taubadel and Fahlbusch (1998) และ Von Cramon-Taubadel and Loy (1999) พบว่าไม่มีความคงเส้นคงวา (Inconsistent) ระหว่าง  $P_t^{\text{in}}$  และ  $P_t^{\text{out}}$  นอกจากนี้การปรับข้อมูลโดยการทำ First Differences ก่อนที่จะนำมาข้อมูลเหล่านั้นไปใช้ในการประมาณการทางเศรษฐมิติต่อไปก่อให้เกิดผลกระทบทำให้แบบจำลองที่ประมาณได้จะขาดข้อมูลในส่วนที่เกี่ยวข้องกับการปรับตัวของตัวแปรต่างๆ ในแบบจำลอง เพื่อก่อให้เกิดดุลยภาพในระยะยาว (Loss of Long-run Economic Information) เพื่อแก้ปัญหาต่างๆดังกล่าว Von Cramon-Taubadel and Fahlbusch (1996) และ Von Cramon-Taubadel and Loy (1999) จึงเสนอให้ใช้วิธีการวิเคราะห์ทางเศรษฐมิติที่เรียกว่า Cointegration และ Error Correction Mechanisms ซึ่งสามารถใช้ในการวิเคราะห์กับข้อมูลอนุกรมเวลาที่มีลักษณะ Non-stationary ได้ รวมทั้งสามารถสร้างแบบจำลองการปรับตัวที่เรียกว่า "Error

Correction Mechanisms" เพื่ออธิบายกระบวนการปรับตัวในระยะสั้นของตัวแปรต่างๆ เพื่อให้เข้าสู่ดุลยภาพระยะยาวได้ (ดูสมการที่ 2.7)

$$\Delta P_{A_t} = \alpha_0 + \alpha_1 \Delta P_{B_t} + \alpha_2^+ ECT_{t-1}^+ + \alpha_2^- ECT_{t-1}^- + \alpha_3(L) \Delta P_{A_{t-1}} + \alpha_4(L) \Delta P_{B_{t-1}} + \varepsilon_t \quad \text{---(2.7)}$$

จากสมการที่ (2.7) ข้างต้นเราสามารถนำ F-test ในการทดสอบว่า  $\alpha_2^+ = \alpha_2^-$  หรือไม่ เพื่อชี้ให้เห็นถึงการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรกันได้

## 2.2.2 สาเหตุของการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตร

สาเหตุของการเกิดการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรกันที่สำคัญมีอยู่ 2 ประการด้วยกัน ได้แก่ (1) ตลาดที่ไม่แข่งขันกัน (Presence of Non-competitive Markets) และ (2) ต้นทุนเมนูและต้นทุนจากการปรับตัว (Existence of Costs) นอกจากนี้ก็ยังมีสาเหตุอื่นๆ อีกที่อาจก่อให้เกิดการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรกัน ได้แก่ การแทรกแซงทางการเมือง (Political Intervention) ความไม่สมมาตรของข้อมูลข่าวสาร (Imperfect Information) และการจัดการสินค้าคงคลัง (Inventory Management)

### 2.2.3.1 อำนาจเหนือตลาด (Market Power)

ในงานวิจัยส่วนใหญ่เกี่ยวกับหัวข้อการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรกันนั้นมักถูกสรุปว่าเกิดจากสาเหตุโครงสร้างตลาดที่ไม่มีการแข่งขันกัน โดยเฉพาะอย่างยิ่งในตลาดเกษตรกรรม ที่มีชาวนาเป็นต้นทุนและมีผู้บริโภคเป็นปลายทางของห่วงโซ่การตลาด โดยเชื่อว่าในภาคค้าปลีกนั้นเปิดโอกาสให้พ่อค้าคนกลางเข้ามาใช้อำนาจเหนือตลาด (Kinnucan and Folker, 1987; Miller and Hayenga, 2001) โดยอำนาจเหนือตลาดนี้ถูกคาดหวังว่าจะนำไปสู่ความไม่สมมาตรทางบวกกล่าวคือการปรับตัวของราคาขาขึ้นจะเร็วกว่าการปรับตัวของราคาในกรณีขาลง เนื่องจากการเพิ่มขึ้นของราคาวัตถุดิบซึ่งจะลดส่วนเหลืออมการตลาดของบริษัท การปรับราคาสินค้าในกรณีขาขึ้นจึงเร็วกว่าในกรณีที่ราคาวัตถุดิบลดลง ด้วยการใช้อำนาจเหนือตลาดของบริษัทที่มีอยู่

อย่างไรก็ตาม Ward (1982) เห็นว่าอำนาจเหนือตลาดสามารถก่อให้เกิดความไม่สมมาตรของการส่งผ่านราคาทางลบได้ หากผู้ขายน้อยรายไม่เต็มใจที่จะเสี่ยงกับการสูญเสียส่วนแบ่งการตลาดจากการเพิ่มราคาสินค้าของบริษัท คล้ายกันกับความเห็นของ Bailey and Brorsen (1989) ที่บอกว่าบริษัทเผชิญกับเส้นอุปสงค์แบบหักงอ (Kinked Demand Curve) กล่าวคือถ้าผู้ผลิตเชื่อว่าคู่แข่งจะไม่แข่งขันด้านราคาเมื่อราคาปรับตัวสูงขึ้น แต่จะมีการแข่งขันด้านราคามากขึ้นเมื่อราคาสินค้าลดต่ำลงเนื่องจากกลัวว่าจะสูญเสียส่วนแบ่งการตลาด ก็จะก่อให้เกิดการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรกันทางบวก จากความคิดเห็นต่างๆข้างต้นจึงยังไม่มีข้อสรุปที่ชัดเจนว่าอำนาจเหนือตลาดจะก่อให้เกิดการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรกันทางบวกหรือทางลบ ทั้งนี้ขึ้นอยู่กับลักษณะของตลาด (เช่น อุปสงค์และอุปทาน) และการคาดคะเนปฏิกริยาโต้ตอบของคู่แข่ง

นอกจากนี้ยังมี Trigger Price Model ที่มีข้อสมมติฐานว่าการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรกันเกิดจากความไม่สมบูรณ์ของข้อมูลข่าวสารเกี่ยวกับการคิดราคาของบริษัทอื่นๆ หลังจากมีการการเปลี่ยนแปลงในราคาวัตถุดิบ ขณะที่ต้นทุนวัตถุดิบมีราคาเพิ่มขึ้นจะส่งผลทำให้ราคาสินค้าเพิ่มขึ้นทันที เพราะจะทำให้ผลกำไรน้อยลง แต่การลดลงของราคาวัตถุดิบจะไม่ส่งผลทำให้ราคาสินค้าเพิ่มขึ้นทันที เนื่องจากบริษัทยังคงสามารถรักษาราคาไว้เหนือระดับการแข่งขัน ตราบเท่าที่ยอดขายของบริษัทยังคงไม่ได้รับผลกระทบ (Borenstein, Cameron and Gilbert, 1997)

แม้ว่าจะมีทฤษฎีในการอธิบายความสัมพันธ์ระหว่างอำนาจเหนือตลาดกับการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรกันหลายทฤษฎีด้วยกัน แต่มีการทดสอบเชิงประจักษ์เพียงเล็กน้อยเท่านั้น ปัญหาที่เกิดขึ้นในการทดสอบก็คือการเลือกตัวประมาณ (Proxy) ที่เหมาะสมเพื่อใช้เป็นตัวแทนอำนาจเหนือตลาด ซึ่งโดยทั่วไปแล้วจะนิยมใช้การวัดการกระจุกตัว (Concentration Measures) เป็นตัวประมาณดังกล่าว แต่กลับพบว่าอัตราการกระจุกตัวไม่ได้มีความสัมพันธ์อย่างสมบูรณ์กับอำนาจเหนือตลาด ตัวอย่างเช่น Neumark and Sharpe (1992) พบหลักฐานสนับสนุนสมมติฐานว่าอัตราการกระจุกตัวของตลาดสามารถส่งผลทำให้เกิดความไม่สมมาตรของการส่งผ่านราคาได้ ในขณะที่ Peltzman (2000) กลับพบผลการศึกษาที่ขัดแย้งกัน กล่าวคืออัตราการกระจุกตัวที่สูงขึ้นกลับนำไปสู่ความไม่สมมาตรที่น้อยลง

### 2.2.3.2 ต้นทุนเมนูและต้นทุนการปรับตัว (Adjustment and Menu Costs)

ต้นทุนการปรับตัวสามารถเกิดขึ้นได้ ถ้าบริษัทเพิ่มหรือลดปริมาณการผลิตหรือราคาของสินค้า และถ้าต้นทุนในการปรับตัวนั้นไม่สมมาตรกันระหว่างการเพิ่มหรือการลดปริมาณการผลิตหรือราคาของสินค้าแล้ว การปรับตัวดังกล่าวก็จะไม่สมมาตรกันด้วย ในกรณีที่มีการเปลี่ยนแปลงราคาของสินค้า เราจะเรียกต้นทุนการปรับตัวนั้นว่าต้นทุนเมนู (Menu Cost)

ในตลาดเนื้อวัวของสหรัฐ Bailey and Brorsen (1989) แสดงให้เห็นว่าเนื้อวัวบรรจุสำเร็จรูป มีต้นทุนคงที่ที่มีนัยสำคัญ ดังนั้นในระยะสั้น แม้ว่าอุปสงค์ในตลาดจะลดลง แต่ผู้ผลิตยอมที่จะได้รับส่วนเหลือมการตลาดลดลงเพื่อรักษากำลังการผลิตของโรงงานไว้ โดยไม่ปรับราคาสูงขึ้น ผลของการแข่งขันระหว่างผู้ประกอบการในอุตสาหกรรมเนื้อวัวบรรจุสำเร็จรูปจึงก่อให้เกิดความไม่สมมาตรของการส่งผ่านราคาทางลบ

ในทางตรงกันข้าม Peltzman (2000) ได้โต้แย้งว่าบริษัทสามารถที่จะลดปริมาณปัจจัยการผลิตลงเพื่อผลิตสินค้าน้อยลงได้ง่ายกว่าการแสวงหาปัจจัยการผลิตใหม่ๆเพิ่มเติมเพื่อเพิ่มปริมาณการผลิต เนื่องจากการแสวงหาปัจจัยการผลิตใหม่นั้นมีต้นทุนในการค้นหา จึงส่งผลกระทบต่อกระบวนการปรับราคาในกรณีเพิ่มปริมาณการผลิตมากกว่า

นอกจากทฤษฎีข้างต้นแล้ว Ward (1982) มีคำอธิบายเพิ่มเติมเกี่ยวกับสินค้าที่สามารถเน่าเสียได้ง่าย (Perishable Products) โดยเฉพาะสินค้าเกษตร ว่าเป็นปัจจัยที่สำคัญที่ทำให้เกิดการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรกันทางลบ เนื่องจากในกรณีที่ราคาสินค้าต้นทางสูงขึ้น สินค้าเกษตรที่เน่าเสียง่ายอาจเผชิญกับต้นทุนจากการปรับราคาสินค้าขึ้น เพราะถ้าปรับราคาสูงขึ้นอาจทำให้ขายสินค้าได้ไม่หมดก่อนที่สินค้าดังกล่าวจะเน่าเสีย ผู้ขายปลีกจึงอาจเลือกที่จะไม่ปรับราคาสูงขึ้นแทนแม้ว่าจะทำให้ส่วนเหลือมการตลาดที่ได้รับลดลง นอกจากนั้นก็มีการของ Ball and Mankiw (1994) ที่พัฒนาตัวแบบต้นทุนเมนูประกอบกับตัวแปรอัตราเงินเฟ้อ เพื่อใช้อธิบายการปรับราคาที่ไม่สมมาตร

กล่าวโดยสรุป แม้ว่าต้นทุนการปรับตัวและต้นทุนเมนูก่อให้เกิดความไม่สมมาตรของการส่งผ่านราคา แต่ยังให้ผลที่ขัดแย้งและคลุมเครือเช่นเดียวกับผลของอำนาจเหนือตลาด อย่างไรก็ตามพบว่าอำนาจเหนือตลาดสามารถส่งผลกระทบต่อขนาดของการปรับตัวที่ใช้ระยะเวลานานกว่าผลกระทบของต้นทุนการปรับตัวและต้นทุนเมนู (Von Cramon-Taubadel and Meyer, 2002: 6-7)

### 2.2.3.3 สาเหตุอื่นๆ (Miscellaneous)

มีทฤษฎีอื่นๆ เกี่ยวกับสาเหตุของการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรกันอยู่หลายทฤษฎี โดยเฉพาะในภาคเกษตรกรรมที่บ่อยครั้งพบว่า มีการแทรกแซงจากภาครัฐด้วยการประกันราคาขั้นต่ำ Kinnucan and Folker (1987) อธิบายว่าการแทรกแซงทางการเมืองของภาครัฐอาจนำไปสู่การปรับตัวของราคาที่ไม่สมมาตรกัน ถ้าพ่อค้าขายปลีกและพ่อค้าขายส่งเชื่อว่าราคาฟาร์มที่ลดลงนั้นเป็นเรื่องชั่วคราว

ต่อมา Bailey and Brorsen (1989) แสดงให้เห็นว่าการปรับตัวของราคาที่ไม่สมมาตรกันสามารถเกิดขึ้นได้จากความไม่สมมาตรของข้อมูลข่าวสาร (Asymmetric Information) ถ้าบริษัทขนาดใหญ่ได้รับผลประโยชน์จากการประหยัดต่อขนาดในการเก็บรวบรวมข้อมูลข่าวสาร ความไม่สมมาตรของข้อมูลข่าวสารระหว่างบริษัทที่แข่งขันกันก็จะเกิดขึ้น และนำไปสู่การการปรับตัวของราคาที่ไม่สมมาตรในที่สุด

การจัดการสินค้าคงคลังก็เป็นอีกสาเหตุหนึ่งที่สามารถก่อให้เกิดการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรกัน Balke, Brown and Yucel (1998) ชี้ให้เห็นว่าวิธีการจัดการสินค้าคงคลัง เช่น วิธี First In - First Out สามารถก่อให้เกิดการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรกันเช่นเดียวกัน

## 2.3 ทฤษฎีโครงสร้างอุตสาหกรรมสมัยใหม่ (New Empirical Industrial Organization)<sup>5</sup>

ในขณะที่การศึกษาตามแนวคิดโครงสร้าง พฤติกรรมและผลการดำเนินงาน หรือ Structure-Conduct-Performance มุ่งพิจารณาคำถามเกี่ยวกับความสัมพันธ์ระหว่างบทบาทและโครงสร้างและให้ความสำคัญเพียงเล็กน้อยแก่คำถามที่ว่า จะวัดบทบาทอย่างไร ในทางตรงกันข้าม วิธีการวิจัยสมัยใหม่จะเน้นการวัดบทบาท หรืออำนาจเหนือตลาด การศึกษานี้เริ่มโดยการปฏิเสธการวัดบทบาทแบบดั้งเดิม เนื่องมาจากความยุ่งยากทางบัญชี การศึกษานี้จะประมาณอำนาจเหนือตลาดใช้แบบจำลองซึ่งอาศัยทฤษฎีของพฤติกรรมการหากำไรสูงสุด

นักวิจัยใช้แบบจำลองสภาพนิ่ง และแบบจำลองหลายงวด (Multiperiod Models) เพื่อกะประมาณอำนาจเหนือตลาด นักเศรษฐศาสตร์บางคนอาศัยการสังเกตต้นทุนเพิ่มและราคา

---

<sup>5</sup> ดูรายละเอียดเพิ่มเติมได้ใน Carlton, D.W. and Perloff, J.M. 2000. Modern Industrial Organization. 3 rd Ed. Addison Wesley: 260-272.

โดยทางตรงและทางอ้อม บางคนสังเกตพฤติกรรมของผลผลิตหรือราคาเพื่อจะดูถึงความสอดคล้องกับแบบจำลองแข่งขันสมบูรณ์

### 2.3.1 การศึกษาแบบสภาพนิ่ง (Static Studies)

การศึกษาศัพท์ใหม่โดยอาศัยแบบจำลองสภาพนิ่งสามารถแบ่งออกเป็นการกะประมาณต้นทุนเพิ่มโดยตรง การกะประมาณโดยใช้แบบจำลองทั้งหมดของตลาด เพื่อที่จะทดสอบว่า อุตสาหกรรมมีการแข่งขันหรือไม่

#### 2.3.1.1 การกะประมาณต้นทุนเพิ่มโดยการใช้ข้อมูลต้นทุนโดยตรง

วิธีที่ดีที่สุดที่จะตอบคำถามแรกเกี่ยวกับดีกรีของอำนาจเหนือตลาด (Market Power) ในอุตสาหกรรมก็คือ การคำนวณส่วนเหลือมราคาต้นทุนโดยตรง (Price-Cost Markup) ถ้าหาข้อมูลต้นทุนทั้งหมดได้ นักเศรษฐศาสตร์จะสามารถกะประมาณความสัมพันธ์ระหว่างต้นทุนทั้งหมด และผลผลิตทั้งหมด และคำนวณหาต้นทุนเพิ่ม ส่วนเหลือมราคาต้นทุน (Price-Cost Margin) อย่างไรก็ตาม ในความเป็นจริงพบว่าข้อมูลต้นทุนทั้งหมดหาได้ยาก เนื่องจากข้อมูลเกี่ยวกับต้นทุนการตลาดของบริษัทมักถูกเก็บเป็นความลับ จึงมักมีปัญหาในการเก็บรวบรวมข้อมูล

#### 2.3.1.2 การกะประมาณส่วนเหลือมโดยใช้แบบจำลองอุตสาหกรรม

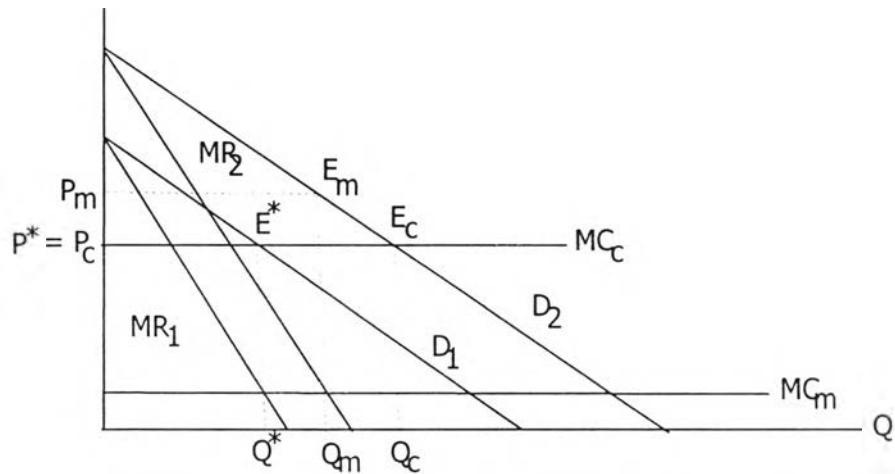
ในกรณีที่ไม่สามารถหาข้อมูลต้นทุนทั้งหมดได้ จะส่งผลกระทบทำให้เราไม่สามารถกะประมาณต้นทุนเพิ่มโดยตรง นักเศรษฐศาสตร์จึงคำนวณส่วนเหลือมราคา-ต้นทุนโดยใช้ข้อมูลสมมติฐานเกี่ยวกับรูปร่างของเส้นอุปสงค์แทน

จากรูปที่ 2.1 สมมติว่าในอุตสาหกรรมหนึ่งมีอุปสงค์  $D_2$  ในรูป 9.2 อยู่ที่ราคา  $P^*$  และปริมาณ  $Q^*$  ดุลยภาพนั้นถูกผลิตโดยอุตสาหกรรมแข่งขันสมบูรณ์ พร้อมด้วย  $MC_C$  หรือโดยบริษัทผูกขาดที่มี  $MC_m$  (ซึ่งตัดกับเส้นรายรับเพิ่มของบริษัทผูกขาด  $MR_1$  ที่  $Q^*$ ) ด้วยข้อมูลนี้เราไม่สามารถชี้เฉพาะหรือกำหนดต้นทุนเพิ่ม และส่วนเหลือมราคา-ต้นทุน



ถ้าวงต่อไปเส้นอุปสงค์ตลาด  $D_2$  อยู่ทางขวา และขนานกับ  $D_1$  ดังแสดงในรูป เราสามารถกำหนดว่าอุตสาหกรรมเป็นการแข่งขันหรือไม่ หรือ กึ่งแข่งขันกึ่งผูกขาด ถ้าอุตสาหกรรมแข่งขันสมบูรณ์ ดุลยภาพใหม่จะอยู่ที่จุด  $E_C$  ดังนั้นราคายังคงที่  $P_C = p^*$  และผลผลิตเพิ่มขึ้นสู่  $Q_C$  นั่นคือ การเลื่อนเส้นอุปสงค์ไม่ทำให้ราคาเปลี่ยนแปลง เรารู้ว่าต้นทุนเพิ่มอุตสาหกรรมคือ  $MC_C$  และส่วนเหลืออมราคา-ต้นทุนของ Lerner เป็นศูนย์

ถ้าการเปลี่ยนแปลงในอุปสงค์นำไปสู่ดุลยภาพใหม่ที่จุด  $E_m$  ราคาเพิ่มขึ้นจาก  $p^*$  สู่  $p_m$  และปริมาณเพิ่มขึ้นสู่  $Q_m$  ราคาเพิ่มขึ้นสอดคล้องกับพฤติกรรมที่ไม่มีการแข่งขัน ดังนั้นถ้าเรารู้ว่า  $MC$  คงที่ การเลื่อนออกไปของเส้นอุปสงค์จะทำให้รู้ว่าตลาดมีการแข่งขันหรือไม่ ถ้าราคาไม่เปลี่ยนแปลงแสดงว่าตลาดมีการแข่งขันสมบูรณ์ แต่ถ้าราคาเพิ่มขึ้นแสดงว่ามีอำนาจเหนือตลาด



รูปที่ 2.3 อำนาจเหนือตลาด

นักเศรษฐศาสตร์จึงใช้วิธีการนี้เพื่อการประมาณดีกรีของอำนาจเหนือตลาดจาก ส่วนเหลืออมราคา-ต้นทุนเพิ่มที่คำนวณได้ (ดูตารางที่ 2.1)

ตารางที่ 2.1 การประมาณส่วนเหลืออมราคา-ต้นทุน (Price Cost Margin)

การศึกษาของ	อุตสาหกรรม	$\frac{p-MC}{p}$
Bresnahan (1981)	รถยนต์	.10-.34
Appelbaum (1982)	ยาง	.05
	สิงทอ	.07
	เครื่องยนต์ไฟฟ้า	.20
	ยาสูบ	.45
Porter (1983)	รางรถไฟ (คาร์เทล)	.40
Lopez (1984)	อาหารสำเร็จรูป	.50
Roberts (1984)	กาแฟอบ (บริษัทใหญ่สุด)	.60
Spiller and Favaro (1984)	ธนาคารขนาดใหญ่ก่อนลดข้อบังคับ	.88
	ธนาคารขนาดใหญ่หลังลดข้อบังคับ	.40
Suslow (1986)	อลูมิเนียม	.59
Slade (1987b)	การค้าขายน้ำมัน	.10
Karp and Perloff (1989a)	ส่งข้าวออก	.11
Karp and Perloff (1986b)	TVs ขาวดำ	.58
Buschena and Perloff (1991)	น้ำมันมะพร้าวของฟิลิปปินส์ (หลัง 1974)	.89
Wann and Sexton (1992)	เหล้าค็อกเทลผลไม้	1.41
Deodhar and Sheldon (1995)	กล้วย(เยอรมัน)	.26
Genesove and Mullin (1998)	การกลั่นน้ำตาล (1880-1914)	.05
Hyde and Perloff (1998)	การค้าปลีกเนื้อสัตว์ของออสเตรเลีย	$\approx 0$

แหล่งที่มา: Bresnahan (1989, ตาราง 1)

### 2.3.2 วิธีการทางอ้อม (Indirect approach)

นักเศรษฐศาสตร์บางท่านใช้การเปลี่ยนแปลงราคาที่เกี่ยวข้องกับการเปลี่ยนแปลงต้นทุนเพื่อทดสอบว่าอุตสาหกรรมเป็นการแข่งขันสมบูรณ์หรือไม่ โดยไม่มีรายละเอียดข้อสมมติฐานเกี่ยวกับรูปร่างของเส้นต้นทุนเพิ่ม ถ้าต้นทุนเพิ่มเพิ่มขึ้นในจำนวนที่แน่นอนในอุตสาหกรรมที่มีเส้นต้นทุนเพิ่มคงที่ (Constant - MC) ราคาแข่งขันสูงขึ้นจำนวนเท่ากันเพราะว่าราคาเท่ากับต้นทุนเพิ่ม ตัวอย่างในอุตสาหกรรมที่มีการแข่งขันสมบูรณ์ ภาษีต่อหน่วยของเงิน 1 หน่วยทำให้ราคาสูงขึ้น 1 หน่วย จากการสังเกตความสัมพันธ์ระหว่างการเปลี่ยนแปลงราคาและการเปลี่ยนแปลงในต้นทุนทำให้สามารถทดสอบว่าในอุตสาหกรรมมีการแข่งขันหรือไม่

ตัวอย่างเช่น Sumner (1981) ที่พิจารณาผลกระทบของความแตกต่างของภาษีตามรัฐต่างๆของประเทศสหรัฐอเมริกาที่มีต่อราคามูรี ถ้าราคาขายปลีกแตกต่างระหว่างรัฐตามจำนวนของความแตกต่างในภาษี ตลาดค่อนข้างจะแข่งขัน ในทำนองเดียวกัน Ashenfalten and Sullivan (1987) ใช้ภาษีสรรพากร (Excise Tax) ระบุโครงสร้างตลาด

Hall (1988) แสดงการกำหนดอำนาจเหนือตลาดอีกวิธีหนึ่งโดยไม่ระบุข้อสมมติฐานเกี่ยวกับอุปสงค์ เขาแสดงให้เห็นว่าถ้าสมมติว่าอุตสาหกรรมมีผลตอบแทนต่อขนาดคงที่ การเปลี่ยนแปลงทางต้นทุนพอเพียงที่จะระบุอำนาจเหนือตลาด เมื่ออุตสาหกรรมที่มีผลตอบแทนต่อขนาดของผลผลิตเพื่อตอบรับกับอุปสงค์ ถ้าอุตสาหกรรมเป็นการแข่งขันสมบูรณ์ มูลค่าของผลผลิตทั้งหมด (รายรับ) เพิ่มขึ้นโดยจำนวนเดียวกับการเพิ่มขึ้นในต้นทุนทั้งหมด แต่ถ้ามูลค่าของผลผลิตทั้งหมดเพิ่มขึ้นในจำนวนที่มากกว่าต้นทุนที่เพิ่มขึ้นแล้วย่อมแสดงว่าอุตสาหกรรมดังกล่าวไม่ได้แข่งขันกันอย่างสมบูรณ์

### 2.3.3 การศึกษาแบบจำลองที่มีการเล่นหลายงวด (Multiperiod Studies)

ในโลกแห่งความเป็นจริงทุกตลาดเกือบทั้งหมดอยู่ได้นานหลายงวด แบบจำลองหลายงวดจึงถูกนำมาใช้เพื่อกะประมาณอำนาจเหนือตลาด บริษัทกำหนดกลยุทธ์โดยนำเอาพฤติกรรมครั้งก่อนเข้ามาพิจารณา เช่น ถ้าการปรับปรุงต้นทุนมีนัยสำคัญ ต้นทุนในงวดนี้จะขึ้นอยู่กับ การตัดสินใจในงวดที่ผ่านมา หรือ ถ้าอุปสงค์วันนี้ขึ้นอยู่กับการบริโภคเมื่อวานนี้ นักเศรษฐศาสตร์ได้ใช้แบบจำลองหลายงวดอย่างน้อย 2 ประเภทในการกะประมาณอำนาจเหนือตลาด กล่าวคือ แบบจำลอง พฤติกรรมการรวมหัวและแบบจำลองพฤติกรรมที่มีการปรับปรุงต้นทุน

### 2.3.3.1 การรวมหัวกันและเกมการเล่นซ้ำกันสภาพนิ่ง (Repeated Static Games)

Stigler (1964) เห็นว่าโอกาสและความต้องการของบริษัทผู้ขายน้อยรายที่จะรวมหัวกันเป็นพื้นฐานสำหรับอธิบายพฤติกรรมผู้ขายน้อยรายทั้งหมด ในทฤษฎีนี้ ราคาจะต่ำกว่าระดับผูกขาด เนื่องจากข้อผิดพลาดที่จะบังคับคาร์เทลได้อย่างเต็มที่ ในอุตสาหกรรมที่มีหลายบริษัทก็ยิ่งยากในการสืบหาการโกงของบริษัทหนึ่งบริษัทใด ดังนั้นก็ยิ่งมีการโกงมากขึ้นและราคาเฉลี่ยก็จะยิ่งต่ำลง

แบบจำลองเกมของ Stigler เป็นเกมเลิศ (Super Game) ของการเล่นที่ซ้ำๆ กัน เป็นแบบที่การเคลื่อนไหวของราคาขึ้นลงไม่เป็นแบบแผนเนื่องมาจากการเคลื่อนไหวขึ้นลงในอุปสงค์หรือ อุปทานอาจจะก่อให้เกิดการโกง "Cheating" โดยสมาชิกคาร์เทลยากที่จะค้นพบ เพื่อป้องกันบริษัทจากการโกง สมาชิกคาร์เทลทุกรายตกลงว่า ถ้าราคาตลาดลดลงต่ำกว่าระดับหนึ่งคือ "Trigger Price" แต่ละบริษัทจะขยายผลผลิตของตนเองไปสู่ระดับก่อนเป็นคาร์เทล สำหรับระยะเวลาหนึ่งและจะส่งผลทำให้ราคาลดลง ถ้าบริษัทคาดว่าบริษัทอื่นจะยึดติดอยู่กับข้อตกลงนี้บริษัทซึ่งตัดราคาอาจจะได้รับกำไรในระยะสั้น แต่จะขาดทุนตอนสุดท้ายเพราะการแตกแยกของคาร์เทลโดยการลงโทษ

### 2.3.3.2 แบบจำลองสภาพเคลื่อนไหวที่มีต้นทุนการปรับปรุง (Adjustment Cost)

ถ้าบริษัทมีต้นทุนการปรับปรุงมากพอ จากการฝึกอบรมคนงานใหม่ หรือ จากการเก็บปัจจัยหรือผลผลิต (Inventory) หรือจากการสะสมทุน เพื่อหากำไรสูงสุดระยะยาว บริษัทจะต้องวางแผนการทำงานไปหลายช่วงเวลา ตัวอย่างเช่น ถ้าบริษัทต้องจ่ายค่าชดเชยเพื่อเลิกจ้างแรงงาน (ต้นทุนการปรับปรุง) บริษัทจ้างคนงานน้อยลงในงวด  $t$  ถ้าบริษัทเชื่อว่าอุปสงค์จะต่ำกว่าในงวด  $t+1$  ในทำนองเดียวกัน ต้นทุนของบริษัทอาจลดลงตลอดเวลาถ้าบริษัทมีการเรียนรู้โดยประสบการณ์ (Learning by Doing) (ต้นทุนลดลงพร้อมกับการผลิตเพราะคนงานกลายเป็นผู้มีความชำนาญมากขึ้นนั้น เนื่องจากประสบการณ์หรือค้นพบวิธีการผลิตที่ดีขึ้น) การกระทำของบริษัทในงวดนี้มีผลกระทบต่อต้นทุนและกำไรในงวดหลัง ในกรณีตลาดแข่งขันสมบูรณ์

วิธีการสมัยใหม่ (New Empirical Industrial Organization) มีข้อได้เปรียบวิธีวิเคราะห์แบบโครงสร้าง พฤติกรรมและผลการดำเนินงาน (Structure-Conduct-Performance) อยู่ 3 ประการ ได้แก่

- (1) เป็นการกะประมาณบทบาทตลาดแทนที่จะใช้การกะประมาณวิธีทางบัญชี
- (2) ใช้การเปลี่ยนแปลงในตัวแปรภายนอก (Exogenous Variables) (เช่น ค่าจ้าง ภาษี การเติบโตของอุปสงค์) เพื่ออธิบายการเปลี่ยนแปลงในบทบาทแทนที่จะใช้ตัวแปรภายใน (Endogenous) เช่น อัตราการกระจุกตัว
- (3) วิธีการเช่นนี้อยู่บนพื้นฐานของแบบจำลองการหากำไรสูงสุดสำหรับอุตสาหกรรมแต่ละราย ดังนั้นจึงสามารถทดสอบข้อสมมติฐานเกี่ยวกับพฤติกรรมได้

แต่ข้อเสียเปรียบสำคัญของวิธีการนี้คือ แบบจำลองเหล่านี้ต้องการให้มีการสร้างรายละเอียด ข้อสมมติฐานเกี่ยวกับรูปร่างของเส้นอุปสงค์และเส้นอุปทาน รวมถึงพฤติกรรมของผู้ขายน้อยราย ส่งผลทำให้มีความยุ่งยากในการกะประมาณ โดยเฉพาะในกรณีที่สมมติฐานที่กำหนดไม่ตรงกับสภาพความเป็นจริง

## วรรณกรรมปริทัศน์

การตรวจสอบเอกสารในส่วนของงานวิจัยที่เกี่ยวข้องกับวิทยานิพนธ์ฉบับนี้นั้นแบ่งออกเป็น 3 ส่วนด้วยกัน ส่วนแรกเป็นการศึกษาด้านระบบและโครงสร้างการส่งออกข้าว ส่วนที่สองเป็นการศึกษาเกี่ยวกับความสัมพันธ์ระหว่างราคาข้าวหรือการส่งผ่านราคาข้าวในตลาดระดับต่างๆ และส่วนสุดท้ายเป็นการศึกษาเกี่ยวกับการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรกัน

### 2.4 ระบบและโครงสร้างการส่งออกข้าว

การศึกษาด้านระบบและโครงสร้างการส่งออกข้าวของไทยจะช่วยให้เห็นถึงภาพรวมและเข้าใจถึงบทบาทของฝ่ายต่าง ๆ ที่เกี่ยวข้องกับการส่งออกข้าว โดยเฉพาะอย่างยิ่งกลุ่มบริษัทผู้ส่งออกข้าวของไทย

วรรณภา เลี้ยววาริณ (2524) ได้ศึกษาโครงสร้างตลาดส่งออกข้าวจากองค์ประกอบ 3 ส่วน ได้แก่ ระดับการกระจุกตัว (Concentration) ส่วนแบ่งการตลาด (Market Share) และกำแพงการเข้าสู่ตลาด (Barrier to Entry) จากการวิเคราะห์ข้อมูลระหว่างปี พ.ศ. 2506-2519 พบว่าค่า Gini Coefficient ในรอบ 14 ปีที่ทำการศึกษามีค่าตั้งแต่ 0.53 ถึง 0.70 หรือมีค่าเฉลี่ยเท่ากับ 0.65 และมีแนวโน้มลดลงในระยะยาว จึงอาจสรุปได้ว่าการค้าข้าวระดับส่งออกของไทยมีการกระจุกตัวอยู่ในหมู่ผู้ส่งออกรายใหญ่ๆ ในระดับปานกลาง ส่วนแบ่งตลาดของบริษัทข้าวส่งออกมากที่สุด 4 บริษัทมีค่าระหว่างร้อยละ 21 - 34.4 และมีแนวโน้มลดลงตลอดช่วงเวลาที่ทำการศึกษา ในขณะที่ส่วนแบ่งการตลาดของ 8 บริษัทใหญ่มีค่าระหว่างร้อยละ 38 - 51.6 สำหรับส่วนแบ่งตลาดของกลุ่ม 5 เสือมีค่าเฉลี่ยร้อยละ 25 ส่วนบริษัทส่งออกข้าว 10 กลุ่มหรือประมาณ 33 บริษัท มีส่วนแบ่งตลาดเฉลี่ยร้อยละ 60 ในส่วนของอุปสรรคการเข้าสู่ตลาดพบว่าอุปสรรคด้านกฎหมายมีไม่มากนักแต่มีอุปสรรคทางเศรษฐกิจสูง เนื่องจากขาดความสามารถในการหาตลาดส่งออกรวมถึงเงินทุน

ต่อมา เกริกเกียรติ พิพัฒน์เสวีธรรม (2525) ใช้อัตราการกระจุกตัวในธุรกิจในการส่งออกข้าว (Concentration Ratio) เป็นเครื่องมือในการศึกษาโครงสร้างตลาดค้าข้าวระดับส่งออก โดยใช้ข้อมูลในปี พ.ศ. 2522 ในการวิเคราะห์พบว่าธุรกิจที่ส่งออกข้าวใหญ่ที่สุด 5 อันดับแรกสามารถส่งข้าวไปขายต่างประเทศได้ถึง ร้อยละ 32.59 ของปริมาณข้าวส่งออกทั้งหมดในปี 2522 อัตราส่วนนี้เพิ่มขึ้นเป็นร้อยละ 50.84 สำหรับบริษัทที่มีขนาดใหญ่ที่สุด 10 บริษัทแรก ผู้วิจัยให้ความเห็นว่าอัตราการกระจุกตัวนี้มีแนวโน้มที่จะสูงขึ้น โดยให้เหตุผลว่า "...การจัดสรรปริมาณ

ส่งออกของรัฐบาลจะค้ำประกันถึงปริมาณการส่งออกในปีที่ผ่านมาเป็นหลัก ดังนั้นบริษัทที่เคยส่งออกได้มากจึงมักจะได้รับอนุญาตให้ส่งออกได้มากขึ้น นอกจากนี้ก็ปรากฏว่า ในกลุ่มของผู้ส่งออกที่มีการร่วมมือกันมากพอสมควรเพราะฉะนั้นอัตราการกระจุกตัวของ การส่งออกข้าวในทางเป็นจริงแล้ว ย่อมจะมีมากกว่าข้อมูลที่แสดงไว้" (เกริกเกียรติ พิพัฒน์เสรีธรรม, 2525 : 81)

ความเห็นของเกริกเกียรติ พิพัฒน์เสรีธรรม (2525) สอดคล้องกับผลการศึกษาของ ณรงค์ เพชรประเสริฐ (2518) ซึ่งใช้วิธีการศึกษาแนวสถาบัน หรือ Institutional Approach เนื่องจากผู้วิจัยพบว่าผู้ส่งออกข้าวจะต้องเป็นสมาชิกสภาหอการค้าแห่งประเทศไทย และในกรณีที่มีการกำหนดโควต้าส่งออกจะต้องได้รับจัดสรรโควต้าส่งออกข้าวจึงจะส่งออกได้ ซึ่งโดยปกติกระทรวงพาณิชย์จะมอบหมายให้สภาหอการค้าแห่งประเทศไทยเป็นผู้จัดสรร โดยพิจารณาจากประวัติการส่งออกในอดีต นอกจากนี้ คณะอนุกรรมการกำหนดราคาข้าวแห่งสภาหอการค้าแห่งประเทศไทย ซึ่งประกอบด้วยผู้ส่งออกรายใหญ่ๆ ยังทำหน้าที่กำหนดราคาข้าวส่งออกและราคาข้าวขายส่งในกรุงเทพฯ โดยได้รับความเห็นชอบจากทางราชการอีกด้วยลักษณะดังกล่าวนี้จึงทำให้ผู้ประกอบการรายใหม่ยากที่จะเข้าไปแข่งขันได้ แม้ว่าบริษัทที่ประกอบกิจการในการค้าข้าวจะมีอยู่เป็นจำนวนมาก แต่พ่อค้าส่งออกขานิยมตั้งบริษัทส่งออกหลายบริษัทเพื่อหาประโยชน์จากวิธีปฏิบัติการจัดสรรโควต้าส่งออกของรัฐบาล ซึ่งทำให้เชื่อกันว่าการค้าข้าวตกอยู่ภายใต้อิทธิพลของผู้ค้ารายใหญ่เพียงไม่กี่ราย

เพื่อชี้ให้เห็นถึงพัฒนาการของกลุ่มธุรกิจของพ่อค้าส่งออกข้าวและอธิบายถึงบทบาทของกลุ่มพ่อค้าส่งออกข้าวของประเทศไทยในระหว่าง พ.ศ. 2489-2528 ธีรวิวัฒน์ เกียรติกำพลชัย (2532) ใช้วิธีการระบวนการทางเศรษฐกิจแบบประวัติศาสตร์การค้า (Business History) โดยอาศัยทฤษฎีวิวัฒนิยมประวัติศาสตร์กับแนวความคิดวิถีการผลิตเอเซียมาเป็นกรอบในการวิเคราะห์ถึงพฤติกรรมด้านการสะสมทุนของกลุ่มพ่อค้าส่งออกข้าวเหล่านี้ ผลการศึกษาแสดงให้เห็นว่ากลุ่มพ่อค้าผู้ส่งออกข้าวมีความเป็นอิสระจากอำนาจรัฐเต็มที่ เมื่อกลุ่มพ่อค้าส่งออกข้าวไทยได้รวมตัวกันอย่างจริงจังในปี พ.ศ. 2502 ในนาม "กลุ่มข้าวสภาการค้า" และสร้างพลังต่อรองกับรัฐด้วยการจัดตั้งคณะกรรมการสาขาข้าวขึ้น ประกอบด้วย คณะอนุกรรมการตรวจข้าว คณะอนุกรรมการกำหนดราคาข้าว และ คณะอนุกรรมการจัดสรรข้าว ซึ่งแต่เดิมนหน้าที่เหล่านี้เป็นของกระทรวงพาณิชย์ อย่างไรก็ตาม ถึงแม้ว่ากลุ่มพ่อค้าผู้ส่งออกข้าวจะเป็นอิสระจากอำนาจรัฐแต่ก็เป็นกลุ่มซึ่งถือกำเนิดขึ้นจากแรงผลักดันของทุนนิยมภายนอก มิใช่จากปฏิกริยาในรากฐานทางเศรษฐกิจของสังคมไทยเป็นเหตุให้กลุ่มพ่อค้าผู้ส่งออกข้าวมิได้แสดงบทบาทต่อพัฒนาการเศรษฐกิจภายในประเทศ โดยเฉพาะการมีส่วนร่วมในการเปลี่ยนแปลงระบบการผลิตทางการเกษตรที่ล้มล้างของไทย

อัมมาร สยามวาลา และวิโรจน์ ณ ระนอง (2533) ร่วมกันศึกษาเรื่องข้าวทั้งในด้านกระบวนการผลิต กระบวนการค้าข้าวทั้งภายในประเทศและต่างประเทศ โครงสร้างราคาและการกำหนดราคาข้าว รวมถึงการแทรกแซงของรัฐบาลในการค้าข้าว ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับการค้าข้าวระดับส่งออกนั้น ผู้วิจัยพบว่า ข้าวสารที่จะส่งออกไปขายในต่างประเทศนั้น การซื้อขายจะทำการในปริมาณมากๆ ระหว่างโรงสีขนาดใหญ่กับพ่อค้าส่งออกที่กรุงเทพฯ โดยมีร้านหยงเป็นนายหน้าหรือตัวแทนในการติดต่อ และ ราคาข้าวจะถูกกำหนดจากสภาพการค้าข้าวระหว่างประเทศ ความต้องการบริโภคภายในประเทศ และสภาพการผลิตภายในประเทศ โดยปัจจัยทั้งสามนี้จะปรากฏที่กรุงเทพฯ ก่อน เนื่องจากตลาดกรุงเทพฯ เป็นศูนย์กลางของการค้าที่เป็นจุดประสานความต้องการบริโภคทั้งจากภายในและต่างประเทศเข้ากับปริมาณผลผลิตที่มีอยู่ โดยมีผู้ส่งออกทำหน้าที่ประสานความต้องการบริโภคจากต่างประเทศกับสภาพตลาดภายในประเทศ ซึ่งขึ้นอยู่กับขบวนการและโรงสี สำหรับประเด็นเรื่องการค้าข้าวนั้น ผู้วิจัยได้แสดงความเห็นว่า การควบคุมข้าวสารนั้นเป็นหัวใจในธุรกิจการค้าข้าว ผู้ที่มีข้าวสารสมบูรณ์กว่าก็จะมีคู่แข่งได้กำไรจากการค้าข้าวได้สูงกว่า นอกจากนี้แล้ว ถ้ากลุ่มใดเป็นที่ยอมรับในวงการว่ามีข้อมูลที่สมบูรณ์กว่า อย่างเช่นที่พ่อค้าข้าวในประเทศยอมรับว่าผู้ส่งออกเป็นผู้ที่มีข้อมูลที่สมบูรณ์ที่สุด กลุ่มนั้นก็จะมีบทบาทในการกำหนดราคาข้าวในระยะสั้นค่อนข้างสูง

หน่วยวิจัยธุรกิจเกษตร (2539) ได้ศึกษาถึงโครงสร้างและวิถีการตลาดข้าวในประเทศไทย โดยวิธีการอธิบายเชิงพรรณนาและใช้รูปภาพประกอบ ผลการศึกษาพบว่ากลุ่มผู้มีบทบาทสำคัญในตลาดข้าวเปลือก ได้แก่ พ่อค้าคนกลางผู้รวบรวมในระดับท้องถิ่น ผู้ประกอบการโรงสีและผู้ประกอบการตลาดกลาง โดยปริมาณข้าวที่ผลิตเพื่อจำหน่ายคิดเป็นร้อยละ 100 เกษตรกรจะจำหน่ายให้กับพ่อค้าผู้รวบรวมท้องถิ่นร้อยละ 50.90 ตลาดกลางข้าวเปลือกร้อยละ 23.80 โรงสีร้อยละ 19.00 และสถาบันเกษตรกรร้อยละ 6.30 สำหรับพ่อค้าคนกลางในตลาดข้าวสารที่สำคัญ ได้แก่ หยง พ่อค้าขายส่งในกรุงเทพฯ พ่อค้าขายปลีกและผู้ส่งออก ซึ่งเมื่อโรงสีได้ทำการแปรรูปแล้วโรงสีจะจำหน่ายข้าวสารผ่านนายหน้าในกรุงเทพฯ ร้อยละ 65.60 ผู้ค้าส่งร้อยละ 20.70 ผู้ส่งออกร้อยละ 13.70 จากนั้นนายหน้าจะจำหน่ายไปให้พ่อค้าขายส่งร้อยละ 40.60 และพ่อค้าส่งออกร้อยละ 25.00 ส่วนผู้ค้าส่งจะรวบรวมข้าวส่งไปจำหน่ายให้พ่อค้าปลีกร้อยละ 58.90 และผู้บริโภคภายในประเทศร้อยละ 2.40 สำหรับผู้ส่งออกจะทำการส่งออกแก่ต่างประเทศทั้งหมดในอัตราร้อยละ 38.70 และในส่วนของผู้ค้าปลีกนั้นจะจำหน่ายข้าวทั้งหมดให้กับผู้บริโภคภายในประเทศในอัตราร้อยละ 58.90

จากผลการศึกษาของงานวิจัยด้านระบบและโครงสร้างการส่งออกข้าวของไทยที่ตรวจสอบมาแล้วทั้งหมดนั้นชี้ให้เห็นว่า การค้าข้าวระดับส่งออกของไทยมีการกระจุกตัวอยู่ในหมู่



ผู้ส่งออกรายใหญ่ๆ ในระดับปานกลางโดยระดับการกระจุกตัวมีแนวโน้มลดลงเรื่อยในระยะยาว (วรรณภา เลี้ยววาริณ, 2524) อย่างไรก็ตามมีงานวิจัยบางฉบับที่ให้ความเห็นในทางตรงกันข้ามว่าระดับการกระจุกตัวน่าจะมีแนวโน้มเพิ่มมากขึ้นโดยให้เหตุผลว่าการจัดสรรปริมาณส่งออกของรัฐบาลจะค้ำประกันถึงปริมาณการส่งออกในปีที่ผ่านมาเป็นหลัก ดังนั้นบริษัทที่เคยส่งออกได้มากจึงมักจะได้รับอนุญาตให้ส่งออกได้มากขึ้น (ณรงค์ เพชรประเสริฐ, 2518; เกริกเกียรติ พิพัฒน์เสรีธรรม, 2525) ในส่วนบทบาทของผู้ส่งออกที่มีต่อระบบการส่งออกข้าวไทยนั้น ผู้ส่งออกจะทำหน้าที่ประสานความต้องการบริโภคจากต่างประเทศกับสภาพตลาดภายในประเทศ นอกจากนี้ คณะอนุกรรมการกำหนดราคาข้าวแห่งสภาหอการค้าแห่งประเทศไทยซึ่งประกอบด้วยผู้ส่งออกรายใหญ่ๆ ยังทำหน้าที่กำหนดราคาข้าวส่งออกและราคาข้าวขายส่งในกรุงเทพฯ โดยได้รับความเห็นชอบจากทางราชการอีกด้วย (ณรงค์ เพชรประเสริฐ, 2518) นอกจากนี้ผู้ส่งออกยังมีบทบาทในการกำหนดราคาข้าวในระยะสั้นค่อนข้างสูง เนื่องจากผู้ส่งออกเป็นผู้ที่มีข้อมูลที่สมบูรณ์ที่สุด (อัมมาร สยามวาลา และวิโรจน์ ณ ระนอง, 2533)

## 2.5 การศึกษาความสัมพันธ์ของระดับราคาข้าวในตลาดระดับต่างๆ

ทฤษฎีราคาเป็นทฤษฎีพื้นฐานที่สำคัญของเศรษฐศาสตร์สำนักนีโอคลาสสิก ตามทฤษฎีนี้ ราคาที่ยืดหยุ่นจะช่วยให้การจัดสรรทรัพยากรเป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ และการส่งผ่านราคาจะเชื่อมโยงตลาดทั้งต่างระดับและในระดับเดียวกันเข้าด้วยกัน นักเศรษฐศาสตร์ที่ต้องการศึกษาถึงประสิทธิภาพของตลาดจึงต้องสืบค้นกระบวนการส่งผ่านราคา ทั้งนี้งานวิจัยส่วนใหญ่เป็นการวิเคราะห์การถ่ายทอดหรือส่งผ่านราคาจากตลาดในระดับที่เหนือกว่ามายังตลาดที่ต่ำกว่าได้มากน้อยเพียงใด

จากการทบทวนวรรณกรรมปริทัศน์พบว่ามีงานวิจัยที่ศึกษาเกี่ยวกับความสัมพันธ์ของราคาข้าวในตลาดระดับต่างๆ เป็นจำนวนมาก โดยการศึกษาในช่วงแรกนั้นส่วนใหญ่นิยมวิเคราะห์ความสัมพันธ์ดังกล่าวด้วยสมการถดถอยอย่างง่าย

Chuchart and Tongpan (1965) ได้ศึกษาถึงการเคลื่อนไหวของราคาข้าวส่งออกและราคาข้าวขายส่ง ณ กรุงเทพฯ ของข้าวสารชนิด 5% โดยใช้ข้อมูลรายเดือนระหว่างปี พ.ศ. 2499-2506 พบว่าราคาข้าวขายส่ง ณ กรุงเทพฯ ของข้าวสารชนิด 5% เคลื่อนไหวตามการเปลี่ยนแปลงของราคาส่งออกในทิศทางเดียวกัน ขณะเดียวกันการเปลี่ยนแปลงราคาขายส่งจะมีผลกระทบต่อราคาขายปลีกข้าวสาร และราคาข้าวเปลือกตามลำดับ นอกจากนี้ยังพบอีกว่าราคา

ข้าวเปลือกในจังหวัดที่อยู่ใกล้กรุงเทพฯ มากเพียงใด จะยังมีความสัมพันธ์กับราคาส่งออกมากเพียงนั้น ข้อสรุปดังกล่าวสอดคล้องกับ Wagner and Tongpan (1965) ทั้งนี้ความเกี่ยวเนื่องระหว่างระยะทางกับระดับความสัมพันธ์กับราคาส่งออกนั้นอาจมีสาเหตุจากต้นทุนการขนส่งที่เป็นองค์ประกอบสำคัญส่วนหนึ่งของราคาข้าวมีความผันแปรกับราคาน้ำมันในตลาดโลกซึ่งไม่จำเป็นต้องเคลื่อนไหวตามการเปลี่ยนแปลงของราคาส่งออก

เช่นเดียวกับงานศึกษาข้างต้น ใน Ingram (1971) และ Renaud and Suphapipat (1971) พบว่าราคาข้าวส่งออก ราคาข้าวสารภายในประเทศ และราคาข้าวเปลือกมีความสัมพันธ์กันอย่างมาก

นอกจากการศึกษาความสัมพันธ์ระหว่างราคาข้าวดังที่กล่าวมาแล้วใน อัมมาร สยาม- วาลา (2522) ได้ศึกษาเพิ่มเติมถึงการกำหนดราคาข้าวอีกด้วย ผลการศึกษาแสดงให้เห็นว่า แม้ข้าวจะมีหลายชั้นมาตรฐาน มีการซื้อขายกัน ณ ตลาดต่างๆ และแตกต่างกันในแต่ละช่วงเวลา แต่ราคาข้าวต่าง ๆ นั้นมีความสัมพันธ์กันอย่างเป็นระบบ และจะเคลื่อนไหวไปพร้อมๆ กัน โดยราคาข้าวภายในประเทศส่วนใหญ่จะอิงกับราคาข้าวสารที่กรุงเทพฯ (ยกเว้นข้าวเหนียว) ในส่วนของการกำหนดระดับราคาข้าวภายในประเทศนั้น ผู้วิจัยชี้ให้เห็นว่าราคาข้าวถูกกำหนดโดยปัจจัยใหญ่ๆ 3 ประการได้แก่ (1) อุปสงค์และอุปทานของข้าวโดยรวม (2) นโยบายของรัฐบาล และ (3) การคาดคะเนของพ่อค้าข้าวระดับต่างๆ เกี่ยวกับปัจจัยในข้อ (1) และ (2) โดยเฉพาะนโยบายของรัฐบาล

ในงานวิจัยที่ผ่านมาไม่ได้พิจารณาถึงความแปรผันตามฤดูกาล ซึ่งปัจจัยดังกล่าวนี้นับว่าส่งผลกระทบต่อราคาสินค้าเกษตรกรรมเป็นอย่างมาก ภารดี ประเสริฐลาภ (2526) จึงได้ศึกษาถึงความสัมพันธ์ของราคาสินค้าเกษตรกรรมตามฤดูกาล พบว่าความสัมพันธ์ของราคาและความยืดหยุ่นของการส่งผ่านราคา<sup>6</sup> ของตลาดภายในและตลาดส่งออกของข้าวในระยะเก็บเกี่ยว นั้นอยู่ในระดับที่สูงกว่าในระยะหลังเก็บเกี่ยว โดยค่าความยืดหยุ่นของการส่งผ่านราคาในระยะเก็บเกี่ยวและหลังเก็บเกี่ยว คำนวณได้ใกล้เคียง 1.0 สำหรับตลาดขายส่งภายในสู่ตลาดฟาร์ม และสูงสุดไม่เกิน 0.62 ตลาดส่งออกสู่ตลาดภายใน ซึ่งเป็นผลมาจากลักษณะโครงสร้างของตลาดส่งออกข้าวและนโยบายในการแทรกแซงตลาดส่งออกของรัฐ

---

<sup>6</sup> ความยืดหยุ่นของการส่งผ่านราคา หมายถึงเปอร์เซ็นต์หรืออัตราการเปลี่ยนแปลงของราคาปลายทางต่อเปอร์เซ็นต์หรืออัตราการเปลี่ยนแปลงของราคาต้นทาง

เนื่องจากข้อมูลราคาข้าวมีลักษณะเป็นข้อมูลอนุกรมเวลา (Time Series) ซึ่งมักก่อให้เกิดปัญหาสหสัมพันธ์ของตัวรบกวน (Autocorrelation) ดังนั้นในงานของ สุนันทา ตันพัฒนา (2539) จึงได้แก้ไขปัญหาดังกล่าวในวิเคราะห์การส่งผ่านราคาและการเคลื่อนไหวของราคาข้าวไทยในตลาดระดับต่างๆ ด้วยการคำนวณหาค่าความสัมพันธ์ ( $\rho$ ) แล้วจึงนำไปแปลงข้อมูลของตัวแปรทุกตัวในสมการเพื่อขจัดปัญหาสหสัมพันธ์ของตัวรบกวน ซึ่งผลการศึกษาพบว่าความยืดหยุ่นของการส่งผ่านราคาข้าวเปลือกและราคาข้าวสารขายส่งมีค่าประมาณร้อยละ 0.30 ขึ้นไป ส่วนความยืดหยุ่นของการส่งผ่านราคาข้าวสารขายส่งกับราคาข้าวส่งออกมีค่าประมาณร้อยละ 0.60 ขึ้นไป และเมื่อพิจารณาลักษณะการเคลื่อนไหวของราคาข้าวในทุกชั้นมาตรฐานพบว่าราคาในเดือนปัจจุบันมีความสัมพันธ์กับราคาในเดือนที่ผ่านมาแล้วไม่เกิน 2 เดือน ซึ่งแสดงให้เห็นว่าข้อมูลข้าวสารทางด้านราคามีประโยชน์อย่างมากในการกำหนดราคาข้าว

แม้ว่าจะมีการศึกษาถึงความสัมพันธ์ระหว่างราคาข้าวในตลาดระดับต่างๆ มากมายแล้วก็ตาม แต่ยังไม่มียานวิจัยชิ้นใดที่วิเคราะห์ถึงความสัมพันธ์ระหว่างการส่งผ่านราคากับคุณภาพหรือชั้นมาตรฐานของข้าวในเชิงปริมาณ หน่วยวิจัยธุรกิจเกษตร (2539) จึงได้ศึกษาถึงความสัมพันธ์ของระดับราคา สำหรับข้าวเกรดต่างๆ ในตลาดต่างๆ 3 ระดับ คือ ระดับตลาดส่งออก ตลาดกรุงเทพฯ และระดับตลาดกลางหรือโรงสี ซึ่งพบว่าความยืดหยุ่นของการส่งผ่านราคา ในกรณีของการส่งผ่านราคาจากตลาดส่งออกไปสู่ราคาขายส่งตลาดกรุงเทพฯ สำหรับปลายข้าวเท่ากับ 0.98 และสำหรับข้าวขาว 15% คำนวณได้ 0.96 ในกรณีของการส่งผ่านราคา จากตลาดกรุงเทพฯ ไปสู่ราคาขายส่งราคาข้าวเปลือก ณ ตลาดกลาง สำหรับข้าวเปลือกชนิดที่ 3 มีค่าเท่ากับ 0.61 และสำหรับข้าวเปลือกชนิดที่ 2 และ 1 คำนวณได้เท่ากับ 0.57 และ 0.49 ตามลำดับ ซึ่งสรุปได้ว่าราคาข้าวในประเทศถูกกำหนดโดยราคาในตลาดโลก โดยเฉพาะข้าวคุณภาพต่ำและคุณภาพปานกลางมีการแข่งขันกันสูงกว่าข้าว คุณภาพดี

ต่อมา ครุฑฤทธิ์ สิทธิกุล (2540) ได้ศึกษาพฤติกรรมราคาข้าว ได้แยกพิจารณาความสัมพันธ์ของราคาข้าว 3 ระดับตลาด คือราคาที่เกษตรกรได้รับ ราคาขายส่งที่ตลาดกรุงเทพฯ และราคาส่งออก พบว่าความยืดหยุ่นของการส่งผ่านราคา ในกรณีของการส่งผ่านราคาจากตลาดกรุงเทพฯ ไปสู่ราคาขายข้าวเปลือกที่เกษตรกรได้รับ สำหรับข้าวสาร 5% มีความยืดหยุ่นของการส่งผ่านราคาคำนวณได้เท่ากับ 0.453 ส่วนความยืดหยุ่นของการส่งผ่านราคา ในกรณีของการส่งผ่านราคาจากตลาดกรุงเทพฯ ไปสู่ราคาขายข้าวเปลือกที่เกษตรกรได้รับ สำหรับข้าวสาร 5% พบว่ามีค่าความยืดหยุ่นของการส่งผ่านราคาคำนวณได้เท่ากับ 0.903 ค่าความยืดหยุ่นของการส่งผ่านราคาจากราคาส่งออกไปยังราคาขายส่งตลาดกรุงเทพฯ มีค่าสูงกว่าความยืดหยุ่นของการส่งผ่านราคาจากราคาขายส่งตลาดกรุงเทพฯ ไปสู่ราคาที่เกษตรกรได้รับ ซึ่งสะท้อนให้เห็นว่า

การตลาดข้าวระหว่างตลาดส่งออกกับตลาดขายส่งกรุงเทพฯ มีลักษณะการแข่งขันสูงกว่าการตลาดข้าวระหว่างตลาดขายส่งกรุงเทพฯ กับตลาดที่เกษตรกรได้รับ

ในขณะที่การศึกษาส่วนใหญ่เป็นการศึกษาการส่งผ่านราคาระหว่างตลาดต่างระดับกัน แต่การศึกษาของสุณีพร ทวรรณกุล (2542) เป็นการศึกษาในลักษณะของการส่งผ่านราคาในตลาดระดับเดียวกันแต่ต่างท้องถิ่น โดยเป็นการส่งผ่านราคาในระหว่างตลาดกลางในภูมิภาคพบว่าตลาดกลางทำข้าวกำนันทรง และตลาดกลางสินค้าเกษตรพิษณุโลก มีประสิทธิภาพในการส่งผ่านราคาสูงสามารถเป็นตลาดกลางอ้างอิงราคาข้าวเปลือกในตลาดข้าวเปลือกในตลาดท้องถิ่น

อย่างไรก็ตามงานทุกงานที่กล่าวไปข้างต้นนั้นใช้สมการถดถอยอย่างง่ายในการวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาข้าวในตลาดระดับต่างๆ โดยข้อมูลราคาข้าวที่ใช้ในการวิเคราะห์มีลักษณะเป็นข้อมูลอนุกรมเวลา และอาจมีลักษณะเป็น Non-stationary ได้ซึ่งอาจก่อให้เกิดความสัมพันธ์แบบไม่แท้จริง (Spurious Relationships) ในงานของ อิศราพร ตระกูลพร นิमित (2545) จึงได้ใช้หลักการ Cointegration ในการวิเคราะห์ผลของการเชื่อมโยงราคา เนื่องจากสามารถใช้ในการทดสอบตัวแปรทางเศรษฐกิจต่างๆว่า มีความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาวหรือไม่ ผลการศึกษาพบว่า ราคาขายส่งข้าวสาร 100 % และข้าวสาร 5 % ณ ตลาดกรุงเทพฯ นั้นเป็นแหล่งอ้างอิงราคาข้าวเปลือกในตลาดกลางสินค้าการเกษตรจังหวัดพิษณุโลกและสุพรรณบุรี แต่ไม่เป็นแหล่งอ้างอิงราคาของตลาดทำข้าวกำนันทรง เนื่องจากการกำหนดราคาข้าวในตลาดกำนันทรงนั้น มีการอ้างอิงกับราคาส่งออกโดยตรงเช่นเดียวกับราคาขายส่ง ณ ตลาดกรุงเทพฯ ดังนั้นตลาดกรุงเทพฯและตลาดทำข้าวกำนันทรงจึงเป็นแหล่งกำหนดราคาข้าวเปลือกและราคาจะถูกถ่ายทอดไปยังตลาดอื่นๆในท้องถิ่น

จากผลการศึกษาความสัมพันธ์ของระดับราคาข้าวในตลาดระดับต่างๆข้างต้นนั้นสรุปได้ว่า ราคาข้าวทั้งในตลาดต่างระดับและตลาดในระดับเดียวกันต่างมีความสัมพันธ์กันอย่างเป็นระบบและจะเคลื่อนไหวไปพร้อมๆกัน โดยราคาข้าวภายในประเทศส่วนใหญ่จะอิงกับราคาข้าวสารที่กรุงเทพฯ อย่างไรก็ตามระดับของความสัมพันธ์ดังกล่าวจะมากหรือน้อยนั้นจะแตกต่างกันไปตาม คุณภาพของข้าว ฤดูกาล และระยะห่างจากตลาดกลาง

## 2.6 การศึกษาการส่งผ่านราคาข้าวที่ไม่สมมาตร

การศึกษาการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรนับเป็นหัวข้อที่สำคัญหัวข้อหนึ่งในวิชาเศรษฐศาสตร์ เนื่องจากเหตุผล 2 ประการด้วยกัน กล่าวคือ (1) การส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรกัน อาจชี้ให้เห็นถึงกำไรส่วนเกินในทฤษฎีเศรษฐศาสตร์ ซึ่งสะท้อนถึงตลาดแข่งขันที่ไม่สมบูรณ์ และ (2) จากข้อ (1) ปรากฏการณ์ความไม่สมมาตรของการส่งผ่านราคาจึงสามารถใช้เป็นหลักฐานสำหรับภาครัฐบาลในการกำหนดนโยบายเพื่อเข้าแทรกแซงตลาดได้ เพราะโดยทั่วไปแล้ว ปรากฏการณ์ดังกล่าวมักถูกสันนิษฐานว่าเกิดจากอำนาจการตลาด

แม้ว่า หัวข้อการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรนี้จะมีการศึกษากันอย่างกว้างขวางในต่างประเทศ แต่ในประเทศไทยพบว่ามีงานที่ศึกษาถึงประเด็นดังกล่าวเพียงงานเดียวเท่านั้นได้แก่ งานของ Punyasavatsut (1989) ซึ่งได้ศึกษาการส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรของราคาข้าวสารขายส่งต่อราคาข้าวสารขายปลีก โดยใช้ Geometric Lag Estimation<sup>7</sup> ในการวิเคราะห์ โดยค่าสัมประสิทธิ์ที่คำนวณได้จะสะท้อนถึงผลกระทบระยะสั้นและระดับความหนืดของการปรับราคา หรืออีกนัยหนึ่ง ก็คือขนาด (Magnitude) และความเร็ว (Speed) ในการปรับตัวของราคาข้าวสารขายปลีกต่อราคาข้าวสารขายส่งนั่นเอง จากผลการศึกษาแสดงให้เห็นว่า ในระยะสั้นราคาข้าวสารขายปลีกจะไม่ปรับตัวทันทีตามการเปลี่ยนแปลงของราคาข้าวสารขายส่ง แต่ราคาขายปลีกจะค่อยๆ ปรับตัวตอบสนองต่อราคาขายส่ง โดยเฉพาะในกรณีที่ราคาขายส่งปรับตัวต่ำลงราคาขายปลีกจะปรับตัวได้ช้ากว่าในกรณีที่ราคาขายส่งปรับตัวสูงขึ้น ทั้งนี้ผู้วิจัยให้เหตุผลว่าปรากฏการณ์ดังกล่าวเกิดจาก ต้นทุนในการปรับเปลี่ยนราคา (Costs of Changing Price) และความไม่สมบูรณ์ของข้อมูลข่าวสารของผู้บริโภค (Imperfect Knowledge) อย่างไรก็ตาม แม้ว่าตัวแบบ Geometric Lag Estimation ใน Punyasavatsut (1989) จะช่วยแก้ไขปัญหาสหสัมพันธ์ของตัวรบกวน แต่ก็ยังไม่ได้พิจารณาถึงปัญหาความสัมพันธ์แบบไม่แท้จริง (Spurious Regression)

<sup>7</sup> ในการวิเคราะห์ข้อมูลอนุกรมเวลาที่ตัวแปรตามได้รับผลกระทบจากตัวแปรอิสระทั้งหมดในช่วงระยะเวลาหนึ่งนั้นนิยมใช้วิธีวิเคราะห์แบบ Distributed Lag Estimation ซึ่งจะต้องมีการกำหนดจำนวนของตัวแปรล่าช้า (Distributed Lag) อย่างไรก็ตาม ในกรณีที่ต้องใช้ตัวแปรล่าช้าในการประมาณจำนวนมาก การประมาณด้วยวิธี OLS โดยตรง อาจส่งผลกระทบทำให้สูญเสียองศาของความเป็นอิสระและอาจนำไปสู่ปัญหาค่าพารามิเตอร์ที่ไม่เที่ยงตรง (Biased Estimators) เนื่องจากการเกิด Multicollinearity ขึ้น เพื่อแก้ปัญหา นักเศรษฐมิติจึงสร้าง ข้อสมมติเกี่ยวกับรูปแบบของตัวแปรล่าช้าว่ามีลักษณะลดลงแบบเรขาคณิต ทำให้สามารถแปลงรูปแบบจำลองและใช้วิธีการวิเคราะห์แบบ Geometric Lag Estimation แทนได้ (ดูรายละเอียดเพิ่มเติมได้ในภาคผนวก จ)

สำหรับการศึกษาในต่างประเทศนั้น จากการสำรวจของ V. Cramon-Traubadel and Meyer (2002) พบว่ามีงานวิจัยที่เกี่ยวข้องทั้งหมด 38 ฉบับที่ได้รับการตีพิมพ์ในวารสารที่สำคัญ ในจำนวนนี้ 25 ฉบับจากทั้งหมดเกี่ยวข้องกับสินค้าเกษตรกรรม (ในสินค้าเกษตรกรรมนี้มี 12 ฉบับที่เกี่ยวข้องกับผลิตภัณฑ์เนื้อสัตว์) 7 ฉบับจากทั้งหมดเกี่ยวข้องกับอัตราดอกเบี้ย 4 ฉบับจากทั้งหมดเกี่ยวข้องกับผลิตภัณฑ์เชื้อเพลิง และที่เหลือ 2 ฉบับจะศึกษาสินค้าหลายประเภทเพื่อเปรียบเทียบกัน โดยงานวิจัยส่วนใหญ่จะใช้ข้อมูลรายเดือนหรือข้อมูลรายสัปดาห์ (จำนวน 22 ฉบับ และ 11 ฉบับตามลำดับ) สำหรับงานวิจัยที่เหลือใช้ข้อมูลรายวันและข้อมูลรายไตรมาส นอกจากนี้ ผู้วิจัยยังตั้งข้อสังเกตว่ามีความสัมพันธ์กันระหว่างวิธีการที่ใช้ในการวิเคราะห์กับผลที่ได้รับ กล่าวคือ วิธีการวิเคราะห์ด้วยผลต่างลำดับแรก (First Differences) และวิธี Threshold นำไปสู่การปฏิเสธสมมติฐานว่ามีการส่งที่สมมาตรกันในสัดส่วนที่สูงกว่า (68% และ 80% ตามลำดับ) ในขณะที่วิธีวิเคราะห์ด้วยผลรวมของผลต่างลำดับแรก (Summation of First Differences) และวิธี Error Correction Model นำไปสู่การปฏิเสธสมมติฐานว่ามีการส่งผ่านราคาที่สมมาตรกันในสัดส่วนที่ต่ำกว่า (23% และ 45% ตามลำดับ) สำหรับวิธีการวิเคราะห์แบบอื่นๆ นั้น นำไปสู่การปฏิเสธ สมมติฐานว่ามีการส่งที่สมมาตรกันในสัดส่วนเพียง 6% เท่านั้น อย่างไรก็ตาม ยังไม่มีงานวิจัยใดที่ทดสอบข้อสรุปเกี่ยวกับความสัมพันธ์ดังกล่าวอย่างชัดเจน

จากงานวิจัยที่ผ่านมาทั้งหมดข้างต้นนั้นสามารถแบ่งเป็นการศึกษาด้านระบบ และโครงสร้างตลาด การศึกษาด้านความสัมพันธ์ระหว่างราคาข้าวในตลาดระดับต่างๆ และการศึกษาการส่งผ่านราคาข้าวที่ไม่สมมาตร ซึ่งผลการศึกษาพบว่าการกระจุกตัวของธุรกิจค้าข้าวส่งออกในระดับปานกลาง และราคาข้าวส่งออกกับราคาข้าวขายส่งมีความสัมพันธ์กันใกล้ชิด โดยราคาข้าวส่งออกจะมีอิทธิพลในการกำหนดราคาข้าวขายส่ง อย่างไรก็ตามเป็นที่น่าสังเกตว่างานวิจัยด้านระบบและโครงสร้างตลาดข้าวระดับส่งออกนั้นเน้นศึกษาถึงปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อโครงสร้างตลาด โดยมีข้อสมมติฐานเบื้องต้นว่า โครงสร้างตลาดจะส่งผลกระทบต่อผลการดำเนินงานผ่านทางพฤติกรรมตลาดและสามารถวัดอำนาจเหนือตลาดทางอ้อมได้จากลักษณะโครงสร้างตลาด เช่น อัตราการกระจุกตัวของธุรกิจ แต่ไม่มีงานวิจัยชิ้นใดที่มุ่งวัดอำนาจการตลาด หรือความสามารถของธุรกิจในการกำหนดราคาให้สูงกว่าต้นทุนหน่วยสุดท้าย (Marginal Cost) โดยตรง

นอกจากนั้นยังพบอีกว่า ในประเด็นความสัมพันธ์ระหว่างราคาข้าวส่งออกกับราคาข้าวขายส่งนั้น งานวิจัยเกือบทั้งหมดจะใช้วิธีการวิเคราะห์ทางเศรษฐกิจแบบดั้งเดิม (Traditional

Econometric Analysis)<sup>8</sup> (ยกเว้นในการศึกษาของ อิศราพร ตระกูลพรนิมิต (2545) แต่ก็เป็นการศึกษาโดยใช้หลักการ Cointegration ในการวิเคราะห์ว่าราคาข้าวในตลาดระดับต่างๆนั้นมีความสัมพันธ์เชิงดุลยภาพระยะยาวหรือไม่เท่านั้น โดยไม่ได้วิเคราะห์ถึงขนาดของความสัมพันธ์และการปรับตัวของราคาในระยะสั้น) ทั้งที่ความสัมพันธ์ระหว่างตัวแปรทางเศรษฐศาสตร์ที่ประมาณและทดสอบโดยใช้วิธีการวิเคราะห์ทางเศรษฐมิติแบบดั้งเดิมอาจเป็นความสัมพันธ์แบบไม่แท้จริงได้ ถ้าหากข้อมูลอนุกรมเวลาที่ใช้มีลักษณะ Non-stationary หรือ Stochastic Process กล่าวคือค่า Mean หรือ Variance ของข้อมูลเหล่านั้นมีค่าเปลี่ยนแปลงไปตามเวลา<sup>9</sup>

ดังนั้นในวิทยานิพนธ์ฉบับนี้จะใช้วิธีการศึกษาแบบโครงสร้าง พฤติกรรมและผลการดำเนินงาน โดยจะมุ่งวัดอำนาจเหนือตลาดและใช้เครื่องมือทางเศรษฐมิติที่เรียกว่า Cointegration และ Error Correction Mechanisms ในการวิเคราะห์พฤติกรรมกำหนดราคาในระยะสั้น เนื่องจากเครื่องมือทางเศรษฐมิติดังกล่าวสามารถใช้ในการวิเคราะห์ข้อมูลอนุกรมเวลาที่มีลักษณะ Non-stationary ได้ และสามารถสร้างแบบจำลองการปรับตัวที่เรียกว่า “Error Correction Mechanisms” ซึ่งสามารถอธิบายถึงขบวนการปรับตัวในระยะสั้นของตัวแปรต่างๆ เพื่อให้เข้าสู่ดุลยภาพระยะยาว นอกจากนี้ ยังสามารถใช้แบบจำลองดังกล่าวในการวิเคราะห์การส่งผ่านราคาที่ไม่สมมาตรกัน (Asymmetric Price Transmission) เพื่อชี้ให้เห็นถึงส่วนต่างของราคา (Gaps) หรือกำไรส่วนเกิน ในทางทฤษฎีเศรษฐศาสตร์ได้อีกด้วย

---

<sup>8</sup> วิธีการวิเคราะห์ทางเศรษฐมิติแบบดั้งเดิม อาทิเช่น Ordinary Least Squares (OLS) และ Two-Stage Least Squares (TSLS) นั้นมีข้อสมมุติที่สำคัญข้อหนึ่งก็คือ ตัวแปรที่ใช้ในการประมาณการจะต้องมีลักษณะเป็น Stationary ถ้าหากข้อสมมุติดังกล่าวไม่เป็นจริงแล้ว ค่าสัมประสิทธิ์ที่คำนวณได้จะไม่มีประสิทธิภาพและขาดความน่าเชื่อถือ (Hendry, 1986)

<sup>9</sup> ในทางปฏิบัติที่ผ่านมา มักจะแก้ปัญหาดังกล่าวด้วยการปรับข้อมูลโดยการทำ First Differencing ตามวิธีการของ Box and Jenkins (1970) ก่อนที่จะนำมาข้อมูลเหล่านั้นไปใช้ในการประมาณการทางเศรษฐมิติต่อไป อย่างไรก็ตาม การทำ First Differencing ก่อนย่อมก่อให้เกิดผลกระทบเชิงลบอยู่บ้าง ในแง่ที่ว่า แบบจำลองที่ประมาณได้จะขาดข้อมูลในส่วนที่เกี่ยวข้องกับการปรับตัวของตัวแปรต่างๆ ในแบบจำลอง เพื่อก่อให้เกิดดุลยภาพในระยะยาว (Loss of long-run economic Information) (รังสรรค์, 2538)