

ความเป็นมาของปัญหา

องค์การสหประชาชาติ หรือ UN (United Nation) ได้กำหนดให้ประเทศต่างๆ ทั่วโลกต้อง ทำรายงานความเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจและสังคมเพื่อบ่งบอก อัตราความเจริญหรือความเสื่อมของภาวะเศรษฐกิจและสังคม โดยส่วนรวมของแต่ละประเทศ การทำรายงานนั้นจะต้องมีรูปแบบที่มีแนวคิดตลอดจนวิธีการทำที่เป็นมาตรฐาน เชื่อถือได้ โดยการกำหนดคัมรวมแนวคิดและวิธีการที่กระทำโดยตัวแทนกลุ่มประเทศต่างๆ ที่เป็นสมาชิก โดยเฉพาะในกลุ่มโลกทางเสรีนิยมที่มีการปกครองทางการเมืองในระบอบประชาธิปไตย และมีการติดต่อทางการค้ากับต่างประเทศ

รายงานดังกล่าว ได้มีการกำหนดให้มีการจัดทำขึ้นเช่น บัญชีเศรษฐกิจเงินทุน (Flow of Fund Account) บัญชีบุคคลแห่งชาติ และสถิติบัญชีประชาชาติ เป็นต้น โดยเฉพาะสถิติบัญชีรายได้ประชาชาติ เป็นรายงานทางเศรษฐกิจและสังคมที่มีความสำคัญ ซึ่งเป็นที่รู้จักกันดีที่สุดในหมู่นักวิชาการและนักธุรกิจ เพราะในสถิติดังกล่าวประกอบไปด้วยค่าสถิติที่สำคัญต่อการกำหนดนโยบายทางการค้า และทางเศรษฐกิจ เช่น สถิติรายได้ประชาชาติ (NI : National Income, GDP : Gross Domestic Products, GNP : Gross National Products) หรือสถิติรายได้ต่อหัวของประชากรในประเทศ เป็นต้น ซึ่งคำนิยามต่างๆ เหล่านี้อาจหาอ่านได้จากหนังสือ ตำราเกี่ยวกับรายได้ประชาชาติต่างๆ ไป หรือ หนังสือทางเศรษฐศาสตร์ทางด้านมหภาค (Macroeconomics) (S.PINDYCK ROBERT, DANIEL L. RUBINFELD "Econometric Models and Economic Forecasts")

สำหรับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศ (GDP) หมายถึงรายได้เบื้องต้นรวมที่เกิดขึ้นจากการรวบรวมของกิจกรรมต่างๆ ทั้งภาครัฐบาลและเอกชนที่เกิดขึ้นในรอบปีหนึ่งๆ ซึ่งมีวิธีคำนวณอยู่ด้วยกัน 3 วิธี คือ การคำนวณทางด้านรายได้ การคำนวณทางด้านรายจ่าย และการคำนวณทางด้านผลิตผลรวม การคำนวณในแต่ละวิธีนั้นต้องอาศัยข้อมูลสถิติจำนวนมากสำหรับกิจกรรมการผลิตต่างๆ ที่เกิดขึ้นในรอบปีหนึ่งๆ ที่ผ่านมา

การคำนวณสถิติรายได้ประชาชาติดังกล่าวนี้ ในทางปฏิบัติ จะคำนวณเป็นข้อมูลหนึ่งปีต่อครั้งเช่นกัน เมื่อกรณีเศรษฐกิจของโลกเกิดวิกฤตการณ์ต่างๆ เช่น การเกิดภัยพิบัติ หรือ ปรากฏการณ์ผิดปกติทางธรรมชาติ บางอย่างจะทำให้เศรษฐกิจภายในประเทศมีความผันผวน การทราบอัตราความเจริญทางเศรษฐกิจจากรายได้ประชาชาติเป็นรายปีใช้แก้ปัญหาเศรษฐกิจในระยะสั้นไม่ได้ทันทั่วทั้งที่

ดังนั้นการคิดค้นหาวิธีการคำนวณรายได้ประชาชาติให้ได้ออกมาเป็นอนุกรมรายเดือน จึงมีความจำเป็นดังเช่น การศึกษาและจัดทำของธนาคารแห่งประเทศไทย โดย ชนิษฐา มีสุข และ ประพันธ์ สายสงเคราะห์⁽¹⁾ ได้ทดลองจัดทำขึ้นโดยอาศัยตัวแปรทาง เศรษฐกิจการเงินที่สามารถเก็บรวบรวมในระยะสั้น มากระจาย GDP อนุกรมรายปี ให้เป็นอนุกรมรายเดือน รวมทั้งช่วยพัฒนา สหิสกุล และ สมศวี ศึกษมัติ ก็ให้วิธีการประมาณการรายได้ประชาชาติรายเดือนของประเทศไทยในช่วงปี พ.ศ. 2513-2529

วิธีดังกล่าวข้างต้น เป็นตัวอย่างรูปแบบการประมาณการรายได้ประชาชาติให้เป็นอนุกรมรายเดือน โดยอาศัยการกระจายข้อมูลรายได้ประชาชาติอนุกรมรายปีที่นับได้ว่ามีหลักการและเหตุผลเป็นที่ยอมรับในการนำมาใช้

อย่างไรก็ตาม การประมาณการดังกล่าวเป็นการประมาณการ แจกแจงของข้อมูล GDP รวม ไม่ได้แยกการประมาณค่าในแต่ละสาขาย่อย GDP ได้แบ่งออกเป็น สาขาย่อยการผลิตได้เป็น 11 สาขาย่อย คือ สาขา เกษตร สาขาอุตสาหกรรม สาขาเหมืองแร่ สาขาการค้าส่ง - การค้าปลีก สาขาการคมนาคมขนส่ง สาขาการก่อสร้าง สาขาไฟฟ้า-ประปา สาขา การบริการ สาขาที่อยู่อาศัย สาขาการบริหารราชการแผ่นดิน และ สาขาการเงินการธนาคาร

ผู้ศึกษามีความเห็นเห็นว่าผลิตภัณฑ์มวลรวมประชาชาติสาขาการเงิน การธนาคาร มีความสำคัญต่อการชี้วัดสภาวะทางเศรษฐกิจ หากนำวิธีการ ประมาณค่าจากข้อมูลรายปีให้เป็นรายเดือน จะส่งผลต่อการวางแผนพัฒนา การด้านเศรษฐกิจและสังคมในระยะสั้น แก่ประเทศไทยได้เป็นอย่างดี

วัตถุประสงค์ของการศึกษา

การศึกษาคั้งนี้กำหนดวัตถุประสงค์ไว้ 2 ประการ คือ

1. นำวิธีการที่ใช้กับ GDP รวมมาวิเคราะห์ว่ามีความเหมาะสม เพียงใดในการประมาณค่าการกระจาย GDP สาขาการเงินการธนาคารเป็น อนุกรมรายเดือน
2. สร้างข้อมูลที่อ้างอิงได้โดยอาศัยการประมาณค่าที่เหมาะสม สำหรับสถิติผลิตภัณฑ์มวลรวมรายได้ประชาชาติในสาขาการเงินการธนาคาร และสาขาอื่นๆ

ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ

- 1) ทำให้ได้หลักเกณฑ์ในการพิจารณาดัชนีตัวแปรพยากรณ์ (ตัวแปรอิสระ) ที่มีรายงานเป็นรายเดือนและมีความเกี่ยวข้องมากที่สุดกับตัวแปรตาม (ข้อมูลรายได้ประชาชาติรายปีสาขาการเงินการธนาคาร) โดยวิธีการปรับสมการถดถอย ได้พิจารณาจากรูปแบบที่มีค่าความคลาดเคลื่อนสุ่มที่ไม่มีสหสัมพันธ์กันในตนเอง กับ รูปแบบที่มีค่าความคลาดเคลื่อนสุ่มมีสหสัมพันธ์กันในตนเอง (Serial correlation)
- 2) สามารถใช้หลักเกณฑ์ของวิธีการ QLF (Quadratic Lost Function) ในการแก้ปัญหาความไม่ต่อเนื่องของข้อมูลอนุกรมรายเดือนที่ประมาณได้จากข้อมูลรายปี
- 3) สามารถนำค่าจากการกระจาย GDP เป็นรายเดือนมาใช้ประโยชน์ในการสร้างดัชนีชี้ภาวะเศรษฐกิจในแต่ละสาขาย่อยได้ต่อไป ซึ่งเป็นรากฐานที่สำคัญต่อการพัฒนา วิธีการพยากรณ์ทางเศรษฐศาสตร์ โดยการศึกษาจากวัฏจักรของข้อมูลธุรกิจและรายได้ประชาชาติเป็นอย่างดี

สำนักหอสมุด