ดัชนีคาดการณ์ภาวะธุรกิจส่งออก

ความเป็นมา

ดัชนีคาดการณ์ภาวะธุรกิจ เป็นผลผลิตของการสำรวจภาวะธุรกิจ (business survey) ซึ่งเป็นการสำรวจความคิดเห็นของผู้ประกอบการเกี่ยวกับปัจจัยหรือตัวแปร (variables) ต่าง ๆ ที่เป็นตัวกำหนดภาวะธุรกิจในอดีต ปัจจุบัน และความคาดหมายของผู้ประกอบการเกี่ยวกับอนาคตในธุรกิจของตนหรืออนาคตของระบบเศรษฐกิจของประเทศ

การสำรวจภาวะธุรกิจ ได้เริ่มครั้งแรกในประเทศสหรัฐอเมริกา ในช่วงทศวรรษ 1920 ซึ่งได้มีการสอบถามภาวะธุรกิจเป็นครั้งคราว อย่างไรก็ตามการสำรวจภาวะธุรกิจได้มีการจัดทำอย่างจริงจังในช่วงหลังสงครามโลกครั้งที่สอง เมื่อบริษัทเอกชนและนิตยสารเศรษฐกิจหลายฉบับได้เริ่มทำการสำรวจภาวะธุรกิจของประเทศอย่างจริงจังและพิมพ์เผยแพร่ผลการสำรวจต่อสาธารณชน ต่อมาเทคนิคและวิธีการเก็บข้อมูลและการประมวลผลข้อมูลได้รับการพัฒนาให้มีความเหมาะสมและเชื่อถือได้มากขึ้น ในช่วงต้นทศวรรษ 1950 ประเทศต่าง ๆ ในทวีปยุโรป เช่น ฝรั่งเศส เยอรมัน อังกฤษ และอิตาลี ก็ได้เริ่มทำการสำรวจภาวะธุรกิจของประเทศขึ้นบ้าง โดยได้รับการสนับสนุนจากหน่วยงานทั้งภาคราชการ สถาบันกึ่งราชการ และภาคธุรกิจของประเทศ

ในระยะแรก ๆ ที่มีการสำรวจภาวะธุรกิจ จุดมุ่งหมายของการสำรวจมุ่งอยู่ที่ประโยชน์ของผู้ตอบคำถามเป็นส่วนใหญ่ ข้อมูลที่ได้รับกลับคืนมาจะถูกประมวลผลและเผยแพร่ให้ทราบเฉพาะหน่วยงานที่เกี่ยวข้องและกลุ่มผู้ตอบแบบสอบถามเท่านั้น และเก็บเป็นความลับสำหรับบุคคลภายนอกกลุ่ม แต่จากการวิจัยและพัฒนาต่อ ๆ มา ข้อมูลที่ได้จากการสำรวจภาวะธุรกิจได้ถูกพัฒนาให้เป็นเครื่องมือสำหรับการวิเคราะห์ปัญหาเศรษฐกิจของภาคอุตสาหกรรม ปัญหาระบบเศรษฐกิจของประเทศและเพื่อการเปรียบเทียบระหว่างประเทศ ดัชนีชี้ภาวะเศรษฐกิจหลายชนิดได้ถูกสร้างขึ้นมาจากข้อมูลการสำรวจภาวะธุรกิจ เช่น ดัชนีชี้นำ และดัชนีคาดการณ์ภาวะธุรกิจ เพื่อใช้ในการพยากรณ์อนาคตของธุรกิจและระบบเศรษฐกิจของประเทศ ดังนั้นการสำรวจภาวะธุรกิจจึงไม่ได้มีประโยชน์จำกัดอยู่เฉพาะกลุ่มผู้ตอบคำถามหรือผู้ที่อยู่ในกลุ่มสาขาอุตสาหกรรมเดียวกันอีกต่อไป แต่ยังเป็นประโยชน์ต่อนักธุรกิจทั่วไป นักวิชาการ หน่วยงานเศรษฐกิจและนักวิเคราะห์ปัญหาเศรษฐกิจของประเทศและระหว่างประเทศด้วย ดังนั้นการสำรวจภาวะธุรกิจจึงได้แพร่หลายมากขึ้นในระหว่างประเทศ ปัจจุบันมีมากกว่า 40 ประเทศที่ทำการสำรวจภาวะธุรกิจ โดยเฉพาะกลุ่มประเทศสมาชิกองค์การความร่วมมือทางเศรษฐกิจและ

การพัฒนา (OECD) ทุกประเทศได้จัดทำการสำรวจภาวะธุรกิจโดยเฉพาะประเทศที่พัฒนาแล้ว และในประเทศยุโรป แคนาดา ญี่ปุ่น ออสเตรเลีย นิวซีแลนด์ ฯลฯ

ดัชนีคาดการณ์ภาวะธุรกิจส่งออกของประเทศไทย

สำหรับประเทศไทย ภาคการส่งออกนับเป็นตัวขับเคลื่อนเศรษฐกิจที่สำคัญ ภาครัฐบาลได้ให้ความสนใจกำหนดกลยุทธในการเสริมสร้างความแข็งแกร่ง และความสามารถในการแข่งขันในการส่งออก ซึ่งเป็นแหล่งรายได้สำคัญของเศรษฐกิจไทย

สำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า ได้ริเริ่มจัดทำดัชนีคาดการณ์ภาวะธุรกิจส่งออก โดยนำแนวคิดการจัดทำดัชนีคาดการณ์ภาวะธุรกิจดังกล่าวมาทำการสำรวจความคิดเห็นเกี่ยวกับภาวะเศรษฐกิจภาคธุรกิจส่งออกจากผู้ประกอบการส่งออก เพื่อจัดทำดัชนีชี้วัดภาวะส่งออก ดัชนีดังกล่าวเปรียบเสมือนดัชนีชี้นำภาวะธุรกิจส่งออก และภาวะเศรษฐกิจโดยรวมของประเทศในระยะสั้น

วัตถุประสงค์

1. เพื่อทราบถึงแนวโน้มภาวะการส่งออกในระยะสั้น
2. เพื่อสร้างเครื่องมือหรือระบบสัญญาณเตือนล่วงหน้า (early warning system)
3. เพื่อใช้เป็นตัวแปรในการจัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจ (business cycle)
4. เพื่อเป็นข้อมูลประกอบการตัดสินใจ วางแผน และดำเนินนโยบายต่าง ๆ ทางเศรษฐกิจของรัฐบาลและเอกชน

วิธีการจัดทำ

การคัดเลือกตัวอย่าง

คัดเลือกโดยวิธี Stratified Random Sampling โดยใช้มูลค่าส่งออกและกลุ่มสินค้าเป้าหมายเป็นหลักในการคัดเลือก คลอบคลุมพื้นที่ทั้งกรุงเทพมหานครและภูมิภาค

คำถามที่ใช้ในการสำรวจ

หลักเกณฑ์ในการคัดเลือกคำถามหรือตัวแปรที่จะนำมาสร้างเป็นดัชนี ที่สำคัญประการหนึ่ง คือ ความมีนัยสำคัญในเชิงเศรษฐกิจ (economic significant) ที่สามารถนำผลที่ประมวลมาวิเคราะห์ภาวะเศรษฐกิจหรือชี้ภาวะเศรษฐกิจได้ คำถามที่ใช้ในการจัดทำดัชนีคาดการณ์ภาวะธุรกิจส่งออก มีดังนี้

1. **ยอดรวมสินค้าส่งออก** (Total Export) หมายถึง มูลค่า(หรือ ปริมาณ) การขายสุทธิ ที่หักสินค้าส่งคืนแล้ว ณ เดือนที่ทำการสำรวจ ยอดรวมสินค้าส่งออกเป็นเครื่องชี้วัดถึงสภาวะการส่งออกในปัจจุบัน ถ้ามูลค่ายอดรวมการส่งออกเพิ่มขึ้น แสดงถึงภาวะการส่งออกขยายตัวซึ่งหมายถึงประเทศมีรายได้จากการส่งออกเพิ่มขึ้น

2. **คำสั่งซื้อใหม่จากต่างประเทศ** (New Export Orders) หมายถึงข้อมูลที่ได้จากเอกสารหรือสัญญาคำสั่งซื้อสินค้าส่งออกที่ได้รับเข้ามาใหม่ในแต่ละเดือนของธุรกิจ ในรอบระยะเวลาที่ทำการสำรวจโดยมีระยะเวลาการส่งมอบแล้วแต่ข้อตกลง

คำสั่งซื้อใหม่ถูกจัดให้เป็นตัวชี้นำ (leading indicator) ภาวะการส่งออก เนื่องจากแสดงถึงภาวะการส่งออกในอนาคต โดยทั่วไปผลผลิตอุตสาหกรรมจะเป็นตัววัดความความแข็งแกร่งของภาคการผลิตของประเทศ ในขณะที่ยอดคำสั่งซื้อใหม่จะเป็นตัววัดความแข็งแกร่งของภาคการผลิตในอนาคต และเนื่องจากเศรษฐกิจของประเทศยังต้องพึ่งพารายได้จากการส่งออก ดังนั้นการสามารถคาดการณ์การขยายตัว หรือหดตัวในอนาคต จะสามารถนำมาคาดการณ์การขยายตัว หรือ หดตัวของเศรษฐกิจของประเทศ

3. **สินค้าคงคลัง** (Inventories) หมายถึง สินค้าที่อยู่ในคลังสินค้ารายเดือนเพื่อรอการผลิตต่อหรือขาย สินค้าคงคลังหมายรวมถึงวัตถุดิบ สินค้ากึ่งสำเร็จรูป และสินค้าสำเร็จรูป

4. **การจ้างงาน** (Employment) หมายถึง จำนวนลูกจ้างที่ปฏิบัติงานในแต่ละเดือน ในการวัดการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจ การจ้างงานเต็มที่มักจะแสดงถึงการขยายตัวของระบบเศรษฐกิจ ดังนั้นในหลายประเทศที่จัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจ การจ้างงานจะเป็นตัวแปรที่เป็นดัชนีพ้องเศรษฐกิจ (coincident indicators)

5. **คาดการณ์ภาวะการส่งออก** (Export Expectation) เป็นการถามความคิดเห็นของผู้ประกอบธุรกิจว่าภาวะการส่งออกของธุรกิจในอีก 3 เดือนข้างหน้าจะเป็นอย่างไร (ดีขึ้น/ไม่เปลี่ยนแปลง/แย่ลง)

6. **คาดการณ์ความสามารถในการแข่งขัน** (Competitive Expectation) โดยพิจารณาจากปัจจัยทางด้านราคา ต้นทุน การใช้แรงงาน การใช้เทคโนโลยี การใช้วัตถุดิบภายในประเทศ

ระยะเวลาการสำรวจ

ดำเนินการสำรวจเป็นรายเดือน สำหรับคำถามที่มีการเปลี่ยนแปลงบ่อย เช่น มูลค่าส่งออก คำสั่งซื้อใหม่ สินค้าคงคลัง การจ้างงาน ส่วนคำถามที่เกี่ยวกับการคาดการณ์จะถามในทุกไตรมาส

การประมวลผลและการคำนวณดัชนี

การประมวลผลจัดทำเป็น 3 ลักษณะ คือ

1.การคำนวณสัดส่วนร้อยละ โดยนำผลการสำรวจมาคำนวณร้อยละของผู้ตอบในแต่ละคำตอบ (% เพิ่มขึ้น % เท่าเดิม% ลดลง)

2.การคำนวณผลต่าง โดยนำผลร้อยละที่เพิ่มขึ้น ลบร้อยละที่ลดลง แสดงถึงอัตราเร่งหรือความเร็วของการขยายตัวหรือหดตัว

3.การคำนวณดัชนี โดยจัดทำเป็นดัชนีการกระจาย (Diffusion Index) ซึ่งเป็นดัชนีที่มีคุณสมบัติเด่นในการเป็นตัวชี้นำ (leading indicator) และแสดงทิศทางการเติบโต (growth) ของภาวะธุรกิจ

การคำนวณดัชนีมีขั้นตอนดังนี้

1.แปลงข้อมูลเชิงคุณภาพ (qualitative) เป็นข้อมูลเชิงปริมาณ (quantitative) ดังนี้

ดีขึ้น	ให้คะแนนเท่ากับ	1
เท่าเดิม	ให้คะแนนเท่ากับ	0.5
ลดลง	ให้คะแนนเท่ากับ	0

2.นำคะแนนทั้งหมดที่ได้มารวมกัน หารด้วยจำนวนผู้ตอบแบบทั้งหมด แล้วคูณด้วย 100 จะได้ดัชนีของแต่ละคาบเวลา ดัชนีจะมีค่าสูงสุดเท่ากับ 100 และค่าต่ำสุดเท่ากับ 0

การอ่านค่าดัชนี ใช้เส้นค่า 50 (break even point) เป็นเกณฑ์ โดย

ถ้าดัชนีอยู่เหนือเส้น	50	แสดงว่านักธุรกิจมองว่าธุรกิจดีขึ้น
ถ้าดัชนีอยู่ที่เส้น	50	แสดงว่านักธุรกิจมองว่าธุรกิจไม่เปลี่ยนแปลง
ถ้าดัชนีอยู่ใต้เส้น	50	แสดงว่านักธุรกิจมองว่าธุรกิจแย่ลง