

การจัดทำคำอธิบายข้อมูล

หมวดสถิติเศรษฐกิจ การเงิน และการคลัง

คำอธิบายข้อมูล

รหัสข้อมูล	FIT_D121
ชื่อข้อมูล	ระบบสัญญาณเตือนภัยทางการคลัง
ความถี่ของข้อมูล	รายเดือน
กำหนดการเผยแพร่	ข้อมูลเบื้องต้น วันทำการสุดท้ายของเดือนถัดไป ข้อมูลจริง จะปรับปรุงแก้ไข (ถ้ามี) และเผยแพร่ในงวดการเผยแพร่ถัดไป
รายละเอียด	<p>ผลลัพธ์จากการจัดทำระบบสัญญาณเตือนภัยทางการคลัง (Fiscal Early Warning System: FEWS) ประกอบด้วย</p> <p>1. ดัชนีรวมเตือนภัยทางการคลัง (Fiscal Early Warning Composite Index) เป็นดัชนีที่ใช้วัดระดับความแข็งแกร่งหรือความอ่อนแอทางการคลัง ซึ่งคำนวณจาก “ผลรวมของการส่งสัญญาณผิดปกติของตัวชี้วัดเตือนภัยทางการคลังล่วงหน้า 14 ตัว ถ่วงน้ำหนักด้วยค่าความแม่นยำ หรือความสามารถในการทำนายวิกฤตการณ์คลัง ล่วงหน้าของแต่ละตัวชี้วัด” โดยดัชนีรวมฯ แบ่งออกเป็น 5 ระดับ ได้แก่ ระดับที่ 1 แข็งแกร่งมาก 0-20 ระดับที่ 2 แข็งแกร่ง 21-40 ระดับที่ 3 เผื่อระวัง 41-60 ระดับที่ 4 ควรออกมาตราการรองรับวิกฤต 61-80 ระดับที่ 5 วิกฤต 81-100 (ในช่วงวิกฤตเศรษฐกิจปี 2540 ค่าดัชนีรวมอยู่ที่ระดับ 100)</p> <p>2. ความน่าจะเป็นในการเกิดวิกฤต เป็นผลลัพธ์จากการคำนวณความสามารถในการทำนาย หรือพยากรณ์ของดัชนีรวมในแต่ละระดับของดัชนีรวม (Range of composite index) ซึ่งคำนวณได้จากการแบ่งช่วงของค่าดัชนีรวมฯ ออกเป็นกลุ่มตามระดับของดัชนีรวมจากน้อยไปมาก จากนั้นคำนวณอัตราส่วนของจำนวนครั้ง (จำนวนเดือน) ที่ดัชนีรวมมีค่าตกอยู่ในช่วงระดับที่กำหนด และมีวิกฤตการณ์คลังเกิดขึ้นในช่วงของการมองภาพวิกฤต (Crisis window) ต่อจำนวนครั้ง (จำนวนเดือน) ที่ดัชนีรวมมีค่าตกอยู่ในช่วงระดับที่กำหนด</p> <p>3. จำนวนตัวชี้วัดที่มีการส่งสัญญาณผิดปกติ พิจารณาจากตัวชี้วัดเตือนภัยทางการคลัง 2 กลุ่ม ได้แก่</p> <p>3.1 ตัวชี้วัดสถานะด้านการคลัง จำนวน 6 ตัว ได้แก่ ผลการจัดเก็บรายได้รัฐบาลรวม (Gross Revenue) ผลการจัดเก็บภาษีเงินได้นิติบุคคล ดุลเงินสดตามระบบบัญชีการคลัง (ไม่รวมรายจ่ายชำระ ต้นเงินกู้) ระดับเงินคงคลัง ปลายงวด สัดส่วนเงินคงคลังต่อตัวเงินคลังคงค้าง และการให้สินเชื่อสุทธิของภาคธนาคารแก่ภาคสาธารณะที่มีใช้สถาบันการเงิน</p>

	<p>3.2 ตัวชี้วัดด้านเศรษฐกิจมหภาค จำนวน 8 ตัว ได้แก่ มูลค่าการส่งออกในรูปแบบดอลลาร์ สรอ. อัตราแลกเปลี่ยนอ้างอิง (บาทต่อดอลลาร์ สรอ.) อัตราส่วนหนี้ต่างประเทศระยะสั้นต่อเงินทุนสำรองระหว่างประเทศ ดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET Index) ดัชนีราคาผู้บริโภคทั่วไป ดุลการชำระเงินในรูปแบบดอลลาร์ สรอ. ดุลบัญชีเดินสะพัดในรูปแบบดอลลาร์ สรอ. และอัตราส่วนหนี้ที่ไม่ก่อให้เกิดรายได้ต่อสินเชื่รวมของระบบสถาบันการเงิน</p> <p>ตัวชี้วัดจะส่งสัญญาณเตือนภัย (Warning signals) เมื่อค่าของตัวชี้วัดเปลี่ยนแปลงเกินจากค่าเฉลี่ยหรือระดับที่ยอมรับได้ (Threshold Level) ซึ่งการกำหนดระดับที่ยอมรับได้ในการศึกษานี้จะใช้การวัดตำแหน่งของข้อมูลด้วยค่าสถิติเปอร์เซ็นต์ไทล์ (Percentile) เพื่อวัดการกระจายของข้อมูลในบริเวณปกติ (Normal region) และบริเวณวิกฤต (Critical region)</p>
แหล่งที่มาของข้อมูล	<ol style="list-style-type: none"> 1. สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง 2. กรมบัญชีกลาง 3. ธนาคารแห่งประเทศไทย 4. สำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า กระทรวงพาณิชย์ 5. ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย 6. กรมส่งเสริมการส่งออก
การปรับปรุงข้อมูล	ปรับตามข้อมูลจริง เมื่อแหล่งข้อมูลมีการแก้ไข