

## สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ญ
สารบัญภาพ	ฉ
สารบัญแผนภูมิ	ฉ
<b>บทที่ 1 บทนำ</b>	<b>1</b>
1.1 หลักการและเหตุผล	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	7
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ	7
1.4 ขอบเขตการศึกษา	7
1.5 การเก็บรวบรวมข้อมูล	7
<b>บทที่ 2 ผลงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง</b>	<b>8</b>
<b>บทที่ 3 กรอบทฤษฎีและระเบียบวิธีวิจัย</b>	<b>14</b>
3.1 ทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง	14
3.1.1 แนวคิดการวิเคราะห์ข้อมูลอนุกรมเวลา	14
3.1.2 การทดสอบความนิ่งของข้อมูลอนุกรมเวลา (Unit Root Test)	16
3.1.3 การพยากรณ์ด้วยวิธี Box-Jenkins	18
3.2 ระเบียบวิธีวิจัย	20

บทที่ 4 ผลการศึกษา	25
4.1 การศึกษาราคาน้ำตาลดิบ	25
4.1.1 ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล	25
4.1.2 ผลการวิเคราะห์แบบจำลองอาร์มี	26
4.2 การศึกษาราคาน้ำตาลทรายขาว	33
4.2.1 ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล	33
4.2.2 ผลการวิเคราะห์แบบจำลองอาร์มี	33
บทที่ 5 บทสรุปและข้อเสนอแนะ	40
5.1 สรุปผลการศึกษา	40
5.1.1 การศึกษาราคาน้ำตาลดิบ	40
5.1.2 การศึกษาราคาน้ำตาลทรายขาว	41
5.2 ข้อจำกัด	41
5.3 ข้อเสนอแนะ	42

เอกสารอ้างอิง  
ภาคผนวก  
ประวัติผู้เขียน

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
Copyright© by Chiang Mai University  
All rights reserved

## สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
1.1 แสดงสินค้าส่งออกสำคัญ 20 รายการแรกของไทย ปี 2542 – 2546	2
1.2 แสดงอัตราการขยายตัวและสัดส่วนของการส่งออกสินค้า 20 รายการแรกของไทย	3
1.3 แสดงข้อมูลพื้นฐานอ้อยโรงงานและน้ำตาล	4
3.1 แสดงการพิจารณา ACF และ PACF	21
4.1 แสดงผลการทดสอบความนิ่งโดยวิธี Augmented Dickey Fuller Test (ADF Test)	26
4.2 แสดงค่าสัมประสิทธิ์ของแบบจำลองที่เลือกมาทั้ง 4 แบบจำลอง	27
4.3 แสดงค่าทางสถิติอื่นๆที่สำคัญของแบบจำลอง	28
4.4 แสดงการทดสอบความถูกต้อง	29
4.5 แสดงค่าสถิติจากการทำ Historical Forecast โดยใช้ข้อมูล 119 ค่าสังเกต	29
4.6 แสดงค่าสถิติจากการทำ Ex-post Forecast	30
4.7 แสดงการพยากรณ์ราคาน้ำตาลดิบข้อมูลที่ 123-126	32
4.8 แสดงผลการทดสอบความนิ่งโดยวิธี Augmented Dickey Fuller Test (ADF Test)	34
4.9 แสดงค่าสัมประสิทธิ์ของแบบจำลองที่เลือกมาทั้ง 4 แบบจำลอง	35
4.10 แสดงค่าทางสถิติอื่นๆที่สำคัญของแบบจำลอง	36
4.11 แสดงการทดสอบความถูกต้อง	36
4.12 แสดงค่าสถิติจากการทำ Historical Forecast โดยใช้ข้อมูล 119 ค่าสังเกต	37
4.13 แสดงค่าสถิติจากการทำ Ex-post Forecast	37
4.14 แสดงการพยากรณ์ราคาน้ำตาลดิบข้อมูลที่ 123-126	38

## สารบัญภาพ

รูป	หน้า
1.1 การผลิตน้ำตาลโลกแยกตามประเทศผู้ผลิตที่สำคัญในปี พ.ศ. 2546	5
1.2 การส่งออกน้ำตาลโลกแยกตามประเทศผู้ส่งออกที่สำคัญ ในปี พ.ศ. 2546	6
1.3 ประเทศผู้นำเข้าน้ำตาลจากไทยที่สำคัญปี พ.ศ. 2546	6
4.1 แสดงการเปรียบเทียบราคาน้ำตาลดิบจริงกับราคาพยากรณ์ โดยใช้แบบจำลอง MA(1)MA(17)SMA(12)	31
4.2 แสดงการเปรียบเทียบราคาน้ำตาลดิบจริงกับราคาพยากรณ์ โดยแบ่งออกเป็น 3 ช่วง	32
4.3 แสดงการเปรียบเทียบราคาน้ำตาลทรายขาวจริงกับราคาพยากรณ์ โดยใช้แบบจำลอง MA(1)MA(17)SMA(12)	38
4.4 แสดงการเปรียบเทียบราคาน้ำตาลทรายขาวจริงกับราคาพยากรณ์ โดยแบ่งออกเป็น 3 ช่วง	39

## สารบัญแผนภูมิ

แผนภูมิ	หน้า
3.1 แสดงขั้นตอนในการพยากรณ์	23
3.2 แสดงขั้นตอนการวิจัยโดยวิธี Box-Jenkins	24



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
Copyright© by Chiang Mai University  
All rights reserved