

## สารบัญ

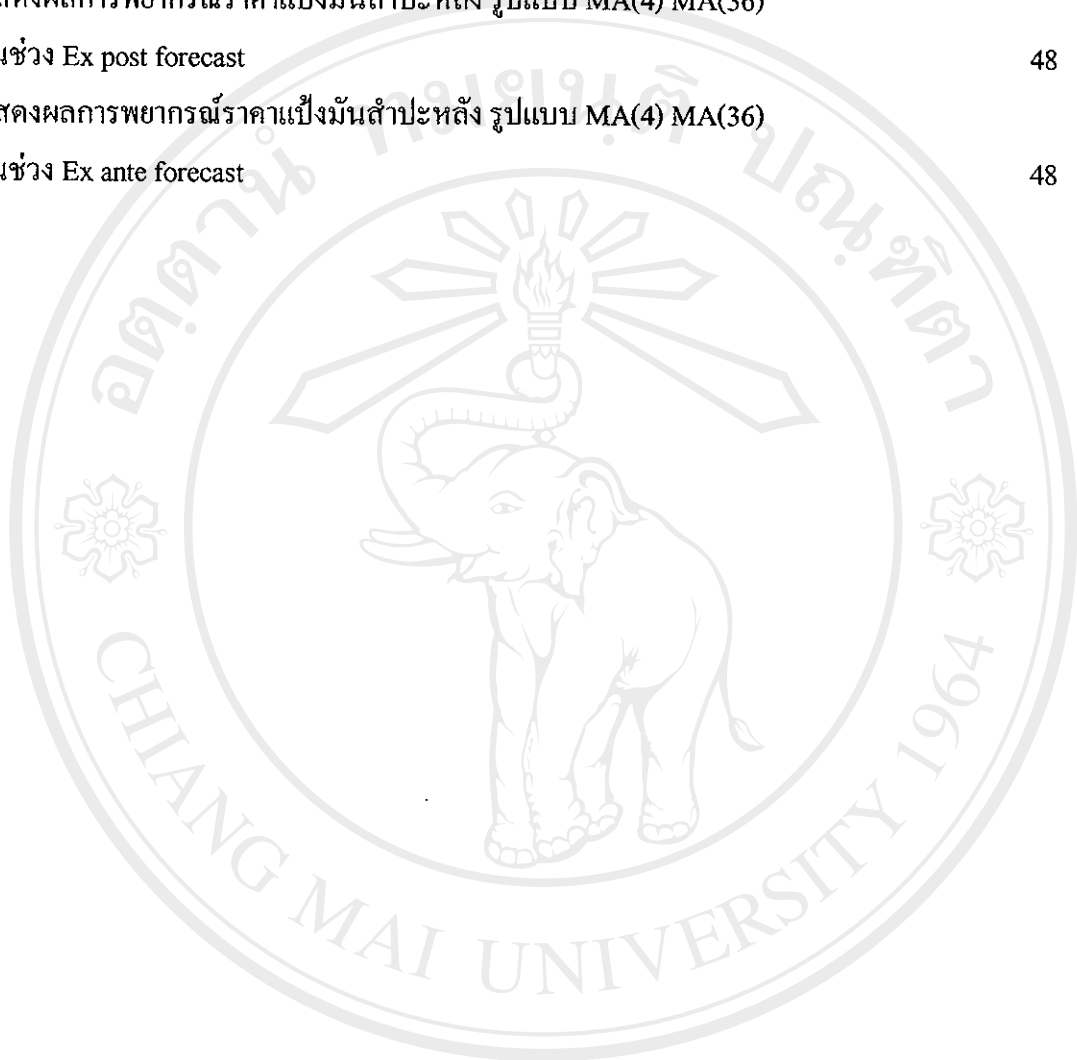
	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ญ
สารบัญภาพ	ฎ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	9
1.3 ขอบเขตของการศึกษา	10
1.4 แหล่งที่มาของข้อมูล	10
1.5 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ	10
1.6 นิยามศัพท์	10
บทที่ 2 ผลงานและการศึกษาที่เกี่ยวข้อง	12
บทที่ 3 กรอบแนวคิดและระเบียบวิธีการศึกษา	
3.1 กรอบทฤษฎีแนวคิดของการศึกษา	19
3.1.1 การทดสอบความนิ่งของข้อมูลอนุกรมเวลา	19
3.1.2 วิธีการพยากรณ์ โดยวิธี Box และ Jenkins	21
3.2 ระเบียบวิธีวิจัย	29
บทที่ 4 ผลการศึกษา	
4.1 ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูลอนุกรมเวลา (Unit Root Test)	34
4.1.1 ตัวแปรมันเม็ดแข็ง	35
4.1.2 ตัวแปรแป้งมันสำปะหลัง	36

4.2 ผลการวิเคราะห์แบบจำลอง ARIMA โดยวิธี Box-Jenkins	37
4.4.1 การกำหนดรูปแบบของอนุกรมเวลา (Identification)	37
4.4.2 การประมาณรูปแบบของอนุกรมเวลา (Estimation)	37
4.4.3 การตรวจสอบความถูกต้อง (Diagnostics Checking)	42
4.4.4 การพยากรณ์ (Forecasting)	43
บทที่ 5 สรุปและข้อเสนอแนะ	
5.1 สรุปผลการศึกษา	50
5.2 ปัญหา อุปสรรคและข้อเสนอแนะ สำหรับแนวทางการศึกษาต่อไป	53
เอกสารอ้างอิง	54
ภาคผนวก	58
ประวัติผู้เขียน	73

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
1.1 มูลค่าการส่งออกสินค้าเกษตรกรรม 10 อันดับแรก ที่สำคัญของไทย ปี 2541-2546	2
1.2 เนื้อที่เก็บเกี่ยว ผลผลิตและผลผลิตเฉลี่ยต่อไร่ของโลก (พ.ศ. 2541-2543)	3
1.3 อัตรการขยายตัวและสัดส่วนของการส่งออกผลิตภัณฑ์มันสำปะหลังของไทย ปี 2542-2546 (มกราคม-ตุลาคม)	4
1.4 การส่งออกมันเม็ดแข็ง (Hard Pellets)	7
1.5 การส่งออกแป้งมันสำปะหลังดิบ (Native Starch)	8
3.1 แสดงการพิจารณา ACF และ PACF	25
4.1 ผลการทดสอบ Unit Root ของข้อมูลมันเม็ดแข็งและแป้งมันสำปะหลัง	35
4.2 แสดงค่าประมาณสัมประสิทธิ์ของรูปแบบ AR(1)	37
4.3 แสดงค่าประมาณสัมประสิทธิ์ของรูปแบบ AR(1) AR(28)	38
4.4 แสดงค่าประมาณสัมประสิทธิ์ของรูปแบบ MA(1)	39
4.5 แสดงค่าประมาณสัมประสิทธิ์ของรูปแบบ MA(4) MA(36)	40
4.6 แสดงค่าประมาณสัมประสิทธิ์ของรูปแบบ MA(4)	40
4.7 แสดงค่าประมาณสัมประสิทธิ์ของรูปแบบ AR(4)	41
4.8 แสดงค่า Q-statistic ที่ได้จากการทดสอบความถูกต้องของรูปแบบมันเม็ดแข็ง	42
4.9 แสดงค่า Q-statistic ที่ได้จากการทดสอบความถูกต้องของรูปแบบแป้งมันสำปะหลัง	42
4.10 แสดงการเปรียบเทียบค่าสถิติราคามันเม็ดแข็งจากการพยากรณ์ ในช่วง Historical forecast	43
4.11 แสดงการเปรียบเทียบค่าสถิติราคามันเม็ดแข็ง รูปแบบต่าง ๆ จากการพยากรณ์ ในช่วง Ex post forecast	44
4.12 แสดงผลการพยากรณ์ราคามันเม็ดแข็ง รูปแบบ AR(1) ในช่วง Ex post forecast	45
4.13 แสดงผลการพยากรณ์ราคามันเม็ดแข็ง รูปแบบ AR(1) ในช่วง Ex ante forecast	45
4.14 แสดงการเปรียบเทียบค่าสถิติราคาแป้งมันสำปะหลัง จากการพยากรณ์ ในช่วง Historical forecast	46

4.15 แสดงการเปรียบเทียบค่าสถิติราคาเบ็งมันสำปะหลัง รูปแบบต่าง ๆ จากการพยากรณ์ ในช่วง Ex post forecast	48
4.16 แสดงผลการพยากรณ์ราคาเบ็งมันสำปะหลัง รูปแบบ MA(4) MA(36) ในช่วง Ex post forecast	48
4.17 แสดงผลการพยากรณ์ราคาเบ็งมันสำปะหลัง รูปแบบ MA(4) MA(36) ในช่วง Ex ante forecast	48



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
Copyright© by Chiang Mai University  
All rights reserved

## สารบัญภาพ

รูป	หน้า
1.1 แสดงราคามันเม็คแข็งส่งออก เอฟ.โอ.บี.กรุงเทพฯ ช่วง ม.ค. 31-ธ.ค. 46	5
1.2 แสดงราคาแป้งมันสำปะหลังส่งออก เอฟ.โอ.บี.กรุงเทพฯ ช่วง ม.ค. 31-ธ.ค. 46	6
3.1 แสดงขั้นตอนการพยากรณ์ โดยวิธีของ Box และ Jenkins	22
3.2 แสดงการพิจารณาผลการพยากรณ์ แบ่งออกเป็น 3 ช่วง	28
3.3 แสดงการพิจารณาผลการพยากรณ์ราคาผลิตภัณฑ์มันสำปะหลัง แบ่งออกเป็น 3 ช่วง	32
4.1 แสดงการพยากรณ์ราคามันเม็คแข็ง จากการพยากรณ์ ในช่วง Historical forecast	44
4.2 แสดงผลการพยากรณ์ราคามันเม็คแข็ง ในช่วงเวลาต่าง ๆ	46
4.3 แสดงการพยากรณ์ราคาแป้งมันสำปะหลัง จากการพยากรณ์ ในช่วง Historical forecast	47
4.4 แสดงผลการพยากรณ์ราคาแป้งมันสำปะหลัง ในช่วงเวลาต่าง ๆ	49