

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ณ
สารบัญภาพ	ญ
บทที่ 1 บทนำ	1
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	15
1.3 ประโยชน์ที่จะได้รับจากการศึกษาเชิงทฤษฎี	15
1.4 ขอบเขตการศึกษา	15
บทที่ 2 วรรณกรรมปริทัศน์	16
บทที่ 3 แนวความคิด ทฤษฎี และระเบียบวิธีการศึกษา	19
3.1 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล	20
3.2 ทฤษฎี อาร์มา โดยวิธี Box-Jenkins	23
บทที่ 4 ผลการศึกษา	34
4.1 ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล	34
4.2 ผลการวิเคราะห์แบบจำลอง อาร์มา โดยวิธี Box-Jenkins	35
บทที่ 5 สรุป อภิปรายผลการศึกษา และข้อเสนอแนะ	47
5.1 สรุปผลการศึกษา	47
5.2 อภิปรายผลการศึกษา และข้อเสนอแนะ	49
เอกสารอ้างอิง	51
ประวัติผู้เขียน	53

สารบัญตาราง

ตาราง		หน้า
3.1	การพิจารณา ACF และ PACF	27
4.1	ค่าสถิติต่างๆ ในการทดสอบ Unit Root	35
4.2	ค่าสถิติที่สำคัญในการประมาณค่าพารามิเตอร์จากแบบจำลองต่างๆ	40
4.3	ค่า Q-statistic ที่ได้จากการทดสอบความเหมาะสมของแบบจำลองต่างๆ	41
4.4	ค่าสถิติ จากการพยากรณ์ในช่วง Historical Forecast	41
4.5	ค่าสถิติ จากการพยากรณ์ในช่วง Ex-post Forecast	44
4.6	ค่าพยากรณ์ราคาส่งออกข้าว จากแบบจำลอง AR(1) AR(19) ในแต่ละช่วงเวลา	46

สารบัญภาพ

รูป		หน้า
1.1	ปริมาณผลผลิตข้าวโลก	2
1.2	สัดส่วนประเทศผู้ผลิตข้าวที่สำคัญของโลก	3
1.3	ปริมาณผลผลิตข้าวไทย	4
1.4	ความต้องการใช้ข้าวในตลาดโลก	5
1.5	ปริมาณการค้าข้าวในตลาดโลก	6
1.6	สัดส่วนประเทศผู้นำเข้าข้าวที่สำคัญในตลาดโลก	7
1.7	สัดส่วนประเทศผู้ส่งออกข้าวที่สำคัญในตลาดโลก	8
1.8	ปริมาณและมูลค่าการส่งออกข้าวไทย	9
1.9	สัดส่วนตลาดส่งออกข้าวคุณภาพสูงของไทย	10
1.10	สัดส่วนตลาดส่งออกข้าวคุณภาพปานกลางของไทย	11
1.11	สัดส่วนตลาดส่งออกข้าวคุณภาพต่ำของไทย	12
1.12	ราคาส่งออกข้าว (FOB) ของไทย ชนิดข้าวขาว 100 % ชั้น 2	13
1.13	ราคาข้าวไทยของตลาดภายในประเทศ	14
3.1	ขั้นตอนการพยากรณ์โดยวิธีของ Box และ Jenkins	25
3.2	ช่วงการพยากรณ์	31
3.3	การกำหนดช่วงการพยากรณ์	33
4.1	ผลพยากรณ์ราคาส่งออกข้าว ในช่วง Historical Forecast จากสมการ (4.8)	42
4.2	ผลพยากรณ์ราคาส่งออกข้าว ในช่วง Historical Forecast จากสมการ (4.5)	43
4.3	ผลพยากรณ์ราคาส่งออกข้าว ในช่วง Ex- post Forecast จากสมการ (4.5)	44
4.4	ผลพยากรณ์ราคาส่งออกข้าว จากแบบจำลอง AR(1) AR(19)	45