

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ญ
สารบัญภาพ	ฎ
บทที่ 1 บทนำ	1
1.1 หลักการและเหตุผล	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	13
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา	13
1.4 ขอบเขตการศึกษา	13
1.5 การเก็บรวบรวมข้อมูล	13
1.6 นิยามศัพท์เฉพาะ	14
บทที่ 2 ทฤษฎีและผลงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	15
2.1 แนวความคิดที่ใช้ในการศึกษา	15
2.1.1 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root Test)	15
2.1.2 แบบจำลองพยากรณ์ โดยวิธี Box – Jenkins	18
2.2 ผลงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	28
บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย	33
บทที่ 4 ผลการศึกษา	35
4.1 การทดสอบ Unit Root	35

4.2 การพยากรณ์โดยแบบจำลองอาร์มีมา	37
4.2.1 ขั้นตอนการกำหนดรูปแบบจำลอง (Identification)	37
4.2.2 ขั้นตอนการประมาณค่า (Estimation)	39
4.2.3 การตรวจสอบความถูกต้อง (diagnostics checking)	50
4.2.4 การพยากรณ์ (Forecasting)	51
บทที่ 5 สรุปผลและข้อเสนอแนะ	57
5.1 สรุปผลการศึกษา	57
5.2 ข้อเสนอแนะ	58
เอกสารอ้างอิง	59
ภาคผนวก	61
ภาคผนวก ก แสดงข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	62
ภาคผนวก ข ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล	63
ภาคผนวก ค แสดงคอเรลโลแกรมของข้อมูล	69
ภาคผนวก ง ค่าสถิติการประมาณค่าพารามิเตอร์	81
ประวัติผู้เขียน	91

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
1.1 มูลค่าสินค้านำเข้าที่สำคัญของประเทศไทย ปี 2546-2549	3
1.2 อัตราการขยายตัวสินค้านำเข้าที่สำคัญของประเทศไทย ปี 2546-2549	4
1.3 สัดส่วนของสินค้านำเข้าที่สำคัญของประเทศไทย ปี 2546-2549	5
1.4 แหล่งนำเข้าทองคำที่สำคัญของประเทศไทย ปี 2546-2549	6
1.5 อัตราการขยายตัวของแหล่งนำเข้าทองคำที่สำคัญของไทย ปี 2546-2549	7
1.6 สัดส่วนของแหล่งนำเข้าทองคำที่สำคัญของไทย ปี 2546-2549	8
1.7 มูลค่าสินค้านำเข้าจากทวีปออสเตรเลีย 10 อันดับแรกของประเทศไทย ปี 2546-2549	10
1.8 อัตราการขยายตัวสินค้านำเข้าจากทวีปออสเตรเลียของประเทศไทย ปี 2546-2549	11
1.9 สัดส่วนการนำเข้าสินค้าจากทวีปออสเตรเลียของประเทศไทย ปี 2546 – 2549	12
2.1 ตารางแสดงการพิจารณา ACF และ PACF	23
4.1 แสดงผลการทดสอบ Unit Root ของราคาทองคำแห่งที่ระดับ Level ต่างๆ โดยวิธี ADF	36
4.2 ค่าสถิติสำคัญที่ได้จากขั้นตอนการกำหนดรูปแบบและการประมาณค่าพารามิเตอร์	38
4.3 ค่าสถิติแบบจำลอง D(GBP) C AR(1) AR(2) MA(1) MA(2)	40
4.4 ค่าสถิติแบบจำลอง D(GBP) C AR(1) AR(3) MA(1) MA(3)	41
4.5 ค่าสถิติแบบจำลอง D(GBP) C AR(1) AR(2) AR(3) MA(2) MA(3)	42
4.6 ค่าสถิติแบบจำลอง D(GBP) C AR(1) AR(3) AR(5) MA(1) MA(3) MA(5)	43
4.7 ค่าสถิติแบบจำลอง D(GBP) C AR(2) AR(3) MA(2) MA(3)	44
4.8 ค่าสถิติแบบจำลอง D(GBP) C AR(3) AR(4) MA(3) MA(5)	45
4.9 ค่าสถิติแบบจำลอง D(GBP) C AR(3) AR(5) MA(3) MA(5)	46
4.10 ค่าสถิติแบบจำลอง D(GBP) C AR(3) AR(4) AR(5) MA(3) MA(5)	47
4.11 ค่าสถิติแบบจำลอง D(GBP) C AR(4) AR(5) MA(4) MA(5)	48
4.12 ค่าสถิติแบบจำลอง D(GBP) C AR(7) AR(14) MA(7) MA(14)	49
4.13 แสดงค่า Q-statistic ที่ได้จากการทดสอบความเหมาะสมของแบบจำลอง	50
4.14 การเปรียบเทียบค่าสถิติจากการพยากรณ์ในช่วง Historical Forecast	52
4.15 การเปรียบเทียบค่าสถิติจากการพยากรณ์ในช่วง Ex-post Forecast	53

4.16 ผลการพยากรณ์ราคาทองคำแท่งในตลาดออสเตรเลียที่ได้จากแบบจำลอง

AR(1) AR(3) AR(5) MA(1) MA(3) MA(5)

55



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบัญภาพ

รูป	หน้า
1.1 สถิติแหล่งนำเข้าทองคำที่สำคัญของไทย 5 อันดับแรก	9
1.2 แผนภูมิแสดงสัดส่วนตลาดนำเข้าทองคำที่สำคัญของประเทศไทย เฉลี่ยจากปี 2546-2549	9
1.3 สถิติรายการสินค้านำเข้าจากทวีปออสเตรเลียที่สำคัญ 5 อันดับแรก	11
2.1 แสดงขั้นตอนของ Box and Jenkins	21
2.2 แสดงช่วงเวลาที่ใช้ในการพยากรณ์	27
4.1 ผลการพยากรณ์ช่วง Historical Forecasting ของราคาทองคำแท่งในตลาดออสเตรเลีย ที่ได้จากแบบจำลอง AR(1) AR(3) AR(5) MA(1) MA(3) MA(5)	52
4.2 ผลการพยากรณ์ช่วง Ex-post Forecast ของราคาทองคำแท่งในตลาดออสเตรเลียที่ได้ จากแบบจำลอง AR(1) AR(3) AR(5) MA(1) MA(3) MA(5)	54
4.3 แสดงผลพยากรณ์ราคาทองคำแท่งในตลาดออสเตรเลียที่ได้จากแบบจำลอง AR(1) AR(3) AR(5) MA(1) MA(3) MA(5) ตั้งแต่เดือน มกราคม 2538 ถึงเดือน เมษายน 2550	56