

การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์ราคาน้ำมันดิบดูไบ
ระหว่างตัวแบบบ็อกซ์และเจนคินส์ ตัวแบบการช
และตัวแบบโครงข่ายประสาทประดิษฐ์

อภิมุข เกียรติศิริกุล

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

มีนาคม 2554

การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์ราคาน้ำมันดิบดูไบ
ระหว่างตัวแบบบ็อกซ์และเจนคินส์ ตัวแบบการزش
และตัวแบบโครงข่ายประสาทประดิษฐ์

อภิมุข เกียรติศิริกุล

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

มีนาคม 2554

การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์ราคาน้ำมันดิบดูไบ
ระหว่างตัวแบบบ็อกซ์และเจนคินส์ ตัวแบบการزش
และตัวแบบโครงข่ายประสาทประดิษฐ์

อภิมุข เกียรติศิริกุล

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ

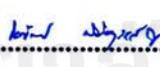

.....ประธานกรรมการ


.....อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก

รศ.อารีย์ เชื้อเมืองพาน

รศ.ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์


.....กรรมการ


.....อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

รศ.ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์

อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิมอนุสรณ์กุล


.....กรรมการ

อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิมอนุสรณ์กุล

2 มีนาคม 2554

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

หนทางที่นำไปสู่ความสำเร็จมักปกคลุมไปด้วยนานาอุปสรรคอันใด การค้นคว้าแบบอิสระครั้งนี้ก็สำเร็จลุล่วงด้วยความยากลำบากนั้น ซึ่งความยากลำบากเหล่านี้มีสามารถเจือจางลงได้ หากขาดการอนุเคราะห์จากผู้มีพระคุณหลายฝ่าย

ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณสำหรับคำแนะนำและข้อคิดเห็นที่มีประโยชน์จาก รองศาสตราจารย์ ดร.ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ ผู้เป็นอาจารย์ที่ปรึกษาหลัก และ ดร.ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์กุล ที่กรุณาเสียสละเวลาอันมีค่าในการชี้แนะแนวทาง แก้ไขตรวจทาน ตลอดจนการรับเป็นอาจารย์ที่ปรึกษาร่วม ขณะที่ความเมตตาของ ดร.ชูเกียรติ ชัยบุญศรี ในการกำกับดูแลโครงเรื่องให้มีความครบถ้วนสมบูรณ์ จักเป็นความซาบซึ้งใจที่ผู้เขียนจารึกเอาไว้ในความทรงจำอย่างมิรู้ลืม

นอกเหนือจากคณาจารย์ทั้ง 3 ท่านแล้ว ผู้เขียนขอขอบพระคุณรองศาสตราจารย์ อารีย์ เชื้อเมืองพาน ประธานกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ ซึ่งให้คำแนะนำสำหรับการปรับปรุงข้อผิดพลาดต่าง ๆ ให้สามารถลุล่วงไปได้ด้วยความเรียบร้อย

อย่างไรก็ดีการค้นคว้าแบบอิสระครั้งนี้คงมีสามารถดำเนินการได้อย่างราบรื่น หากขาดการชี้แนะวิธีประมวลผลข้อมูลจากคุณอื่น และรูปแบบรหัสต้นทางของซอฟต์แวร์ MATLAB จากคุณ เจริญ รวมทั้งการประสานงานและอำนวยความสะดวกมาตลอดหลักสูตรการศึกษาจากเจ้าหน้าที่ประจำคณะเศรษฐศาสตร์ ซึ่งความเอื้อเฟื้อดังกล่าวผู้เขียนใคร่ขอขอบพระคุณอย่างยิ่ง

สำหรับบุคคลสำคัญที่ขาดเสียมิได้ ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณบิดามารดาและครอบครัวที่คอยเป็นกำลังใจมาโดยตลอด สุดท้ายนี้ขอขอบคุณหนูปุก และเพื่อน ๆ ทุกคนที่คอยให้ความช่วยเหลือเสมอมา ดังนั้นคุณค่าของการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้จึงขออุทิศแก่ผู้มีพระคุณทุก ๆ ท่าน ที่ได้กล่าวมาแล้ว ส่วนข้อบกพร่องที่ปรากฏผู้เขียนต้องขออภัยและขออภัยไว้แต่เพียงผู้เดียว

อภิมุข เกียรติศิริกุล