

การพยากรณ์ราคา ข้าวหอมมะลิ ยางพารารมควันชั้น 3 และน้ำตาล  
โดยใช้แบบจำลองอาร์รึมา (ARIMA) อาร์ฟึมา (ARFIMA)  
และการวิเคราะห์อนุกรมเวลาแบบคลาสสิก

จิตรกร บุญเรือง

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กันยายน 2554

การพยากรณ์ราคา ข้าวหอมมะลิ ยางพารารมควันชั้น 3 และน้ำตาล  
โดยใช้แบบจำลองอาร์อีมา (ARIMA) อาร์พีมา (ARFIMA)  
และการวิเคราะห์อนุกรมเวลาแบบคลาสสิก

จิตรกร บุญเรือง

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง  
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by บัณฑิตวิทยาลัย

All rights reserved มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กันยายน 2554

การพยากรณ์ราคา ข้าวหอมมะลิ ยางพารารมวันชั้น 3 และน้ำตาล

โดยใช้แบบจำลองอาร์อีมา (ARIMA) อาร์พีมา (ARFIMA)

และการวิเคราะห์หอนุกรมเวลาแบบคลาสสิก

จิตรกร บุญเรือง

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา  
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

คณะกรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ

.....ประธานกรรมการ

.....อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก

อ.ดร.กัญสุดา นิ่มอนุสรณ์สกุล

อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์สกุล

.....กรรมการ

.....อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์สกุล

อ.ดร.อนัสปรีย์ ไชยวรรณ

.....กรรมการ

อ.ดร.อนัสปรีย์ ไชยวรรณ

.....กรรมการ

รศ.ดร.เรียงชัย ตันสุชาติ

21 กันยายน 2554

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

## กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้สำเร็จลุล่วงลงได้ด้วยความกรุณาของ อ.ดร.ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสตรณีสกุล ประธานที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ ที่ได้กรุณาให้ความรู้ คำแนะนำ และคำปรึกษาที่เป็นประโยชน์ต่อการศึกษา อีกทั้งยังให้ความช่วยเหลือและให้การสนับสนุนในทุกๆ ด้านอย่างดี รวมถึงการตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องต่างๆ ซึ่งผู้เขียนขอขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอขอบพระคุณ อ.ดร.อนันตปรีช ไซยวรรณ ที่กรุณาให้ความรู้ ทำให้ผลงานสำเร็จลงได้ และให้ความกรุณาเป็นอาจารย์ที่ปรึกษาร่วมการค้นคว้าแบบอิสระตรวจสอบข้อผิดพลาดต่างๆ อันส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สมบูรณ์มากยิ่งขึ้น

ขอขอบพระคุณ อ.ดร.กัญสุดา นิ่มอนุสตรณีสกุล ที่กรุณาให้ความรู้ ทำให้ผลงานสำเร็จลงได้ และให้ความกรุณาเป็นประธานกรรมการการค้นคว้าแบบอิสระตรวจสอบข้อผิดพลาดต่างๆ อันส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สมบูรณ์มากยิ่งขึ้น

ขอขอบพระคุณ รศ.ดร.เริงชัย ต้นสุชาติ ที่กรุณาให้ความรู้ ทำให้ผลงานสำเร็จลงได้ และให้ความกรุณาเป็นกรรมการการค้นคว้าแบบอิสระตรวจสอบข้อผิดพลาดต่างๆ อันส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สมบูรณ์มากยิ่งขึ้น

ขอบพระคุณคณาจารย์คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ คณาจารย์รับเชิญทุกท่านที่ได้ให้ความรู้ด้านเศรษฐศาสตร์ ขอบคุณข้าราชการ เจ้าหน้าที่ ตลอดจนบรรณารักษ์ห้องสมุดของคณะเศรษฐศาสตร์ที่ให้คำแนะนำช่วยเหลือ บริการประสานงานและอำนวยความสะดวกต่างๆ เป็นอย่างดีตลอดระยะเวลาที่ศึกษา

ขอบพระคุณหัวหน้าฝ่าย เจ้าหน้าที่ ฝ่ายการเงินและบัญชี มูลนิธิโครงการหลวงทุกท่านที่ได้ให้ความรู้ด้านเศรษฐศาสตร์ คำแนะนำช่วยเหลือ ที่คอยให้กำลังใจ และสนับสนุนในการศึกษาครั้งนี้จนสำเร็จได้สมบูรณ์

ขอบคุณเพื่อนๆ พี่ๆ น้องๆ นักศึกษาปริญญาโทเศรษฐศาสตร์ ที่คอยให้กำลังใจ และสนับสนุนในการศึกษาครั้งนี้จนสำเร็จได้สมบูรณ์

สุดท้ายนี้หากการค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้จะเป็นประโยชน์แก่หน่วยงานที่เกี่ยวข้อง ตลอดจนผู้สนใจข้อมูล ผู้เขียนขอมอบความดีงามให้แก่คุณพ่อ คุณแม่ และน้องสาว ผู้ที่ให้การดูแลและเป็นกำลังใจที่สำคัญยิ่งในการศึกษามาจนทุกวันนี้ ในส่วนของความผิดพลาดหรือข้อบกพร่องประการใด ผู้เขียนขอน้อมรับไว้เพียงผู้เดียว