

## บทที่ 4

### พฤติกรรมของราคาผลปาล์มดิบ

#### 4.1 ค่าแนวโน้ม (Trend: T)

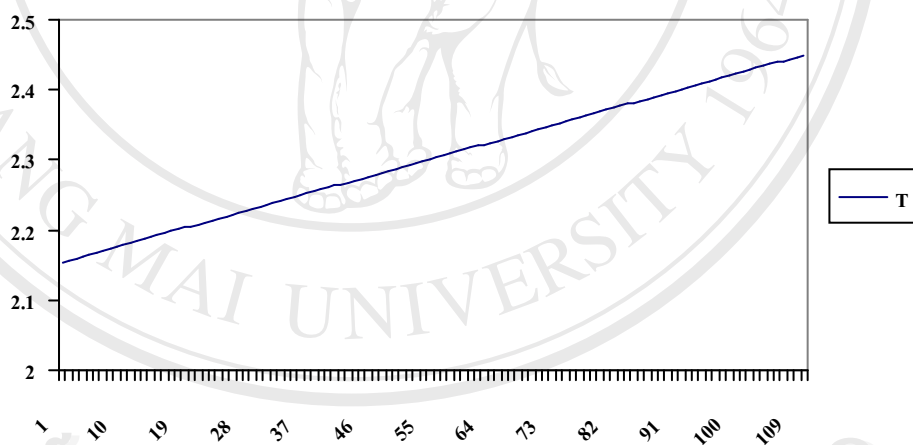
จากการศึกษาราคาผลปาล์มดิบเดือน มกราคม 2539 จนถึงเดือน กุมภาพันธ์ 2548 พบว่าสมการแนวโน้มของราคาผลปาล์มคือ

$$Y = 2.30 + 0.0027t$$

t คือ เวลาที่มีหน่วยเป็น เดือน (0, 1, 2, 3,.....)

Y คือ ราคาผลปาล์มดิบ

จากสมการค่าแนวโน้ม เมื่อนำมาแทนค่า t และมาวาดกราฟ จะเห็นว่าแนวโน้มของผลปาล์มนั้นจะมีแนวโน้มที่เพิ่มขึ้นอย่างต่อเนื่อง (รูป4.1)



รูป 4.1 ค่าแนวโน้มราคาผลปาล์มดิบ ตั้งแต่ปี พ.ศ. 2539 – ปี พ.ศ.2548

หมายเหตุ: T หมายถึงค่าแนวโน้มราคาผลปาล์มดิบ ตั้งแต่ปี พ.ศ. 2539 – ปี พ.ศ.2548

#### 4.2 การเคลื่อนไหวตามฤดูกาล (Seasonal movement: S)

การเคลื่อนไหวประเภทนี้ เคลื่อนไหวขึ้นๆ ลงๆ ซึ่งในเวลาเดียวกัน กล่าวคือ เคยสูงเคยต่ำ ในระยะเวลาใดก็มักจะสูงต่ำในระยะเวลาที่ต่อเนื่องไป อิทธิพลของฤดูกาลนี้โดยปกติจะเกิดขึ้นซ้ำๆ ในลักษณะคล้ายกันทุกปี การเคลื่อนไหวนี้มักจะแสดงในลักษณะสัมพันธ์ คือเป็นจำนวนเปอร์เซ็นต์

หรือเรียกว่าดัชนีฤดูกาล (seasonal index) จากการคำนวณค่าความเคลื่อนไหวตามฤดูกาลจะได้ค่าความเคลื่อนไหวตามฤดูกาล (ตาราง 4.1)

การคำนวณหาค่าความผันผวนแปรตามฤดูกาล(S) มีขั้นตอนดังนี้

1. คำนวณค่าเฉลี่ยเคลื่อนที่ (moving average ; MA) ของข้อมูลอนุกรมเวลา การเฉลี่ยเคลื่อนที่เป็นการขจัดอิทธิพลของฤดูกาล(S) และความผันแปรที่ไม่แน่นอน(I) ออกจากข้อมูล ดังนั้นผลที่ได้จากการเฉลี่ยเคลื่อนที่จึงหมายถึงอิทธิพลของค่าแนวโน้ม(T) และความผันแปรตามวัฏจักร(C)
2. นำค่าเฉลี่ยเคลื่อนที่ที่คำนวณได้ในขั้นที่ 1 ไปหารข้อมูลอนุกรมเวลา (Y) แล้วคูณ 100 เพื่อให้อยู่ในรูปร้อยละ ผลที่ได้จะเป็นค่าของความผันแปรตามฤดูกาล (S) และความผันแปรที่ไม่แน่นอน (I) ที่อยู่ในรูปเปอร์เซ็นต์
3. คำนวณความผันแปรตามฤดูกาล (S) โดยการขจัดค่า ออกจาก (S\*I) โดยวิธีหาค่าเฉลี่ยของ (S\*I) แต่ละช่วงเวลาแต่ก่อนที่จะหาค่าเฉลี่ยให้ตัดค่า (S\*I) ที่มีค่าสูงสุด และต่ำสุด ออกไปก่อนดังนั้นค่าเฉลี่ยของ (S\*I) ที่คำนวณได้จะหมายถึงอิทธิพลของฤดูกาล (S) แต่ละช่วงเวลานั้นเอง และจะมีค่าอยู่ในรูปดัชนี

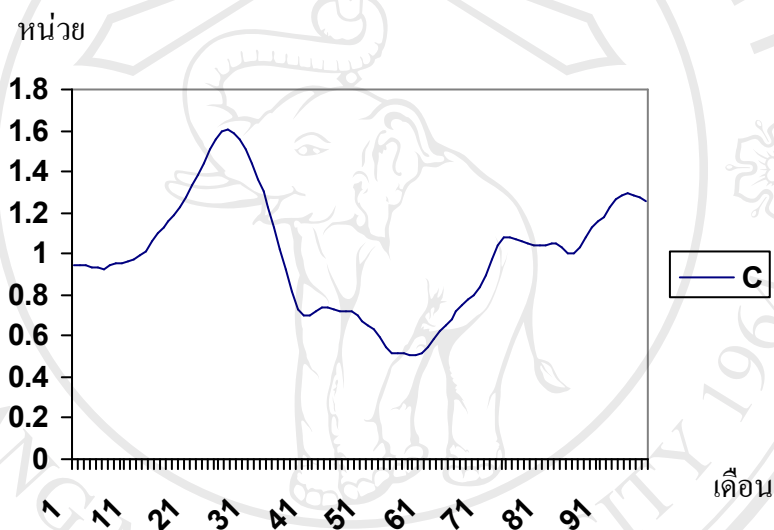
ตาราง 4.1 ค่าความไหวตามฤดูกาล (%)

เดือน	ค่าความไหวเคลื่อนไหวตามฤดูกาล (%)
มกราคม	128.46
กุมภาพันธ์	114.32
มีนาคม	96.95
เมษายน	91.10
พฤษภาคม	87.96
มิถุนายน	95.52
กรกฎาคม	103.30
สิงหาคม	105.44
กันยายน	89.94
ตุลาคม	86.61
พฤศจิกายน	96.26
ธันวาคม	104.11

ที่มา: จากการคำนวณ

จากค่าความไหวเคลื่อนตามฤดูกาล ในเดือนมกราคม เท่ากับ 128.46 หมายความว่า ราคาผลปาล์มดิบในเดือนมกราคมของทุกๆปี คิดเป็น 128.46 % ของราคาผลปาล์มดิบโดยเฉลี่ย แสดงว่าอิทธิพลของฤดูกาลทำให้ราคาผลปาล์มดิบเพิ่มขึ้น  $128.46 - 100 = 28.46$  % และในเดือนพฤษภาคม ค่าความไหวเคลื่อนตามฤดูกาล เท่ากับ 86.61 หมายความว่า ราคาผลปาล์มดิบในเดือน ตุลาคมของทุกๆปี คิดเป็น 86.61 % ของราคาผลปาล์มดิบโดยเฉลี่ย แสดงว่าอิทธิพลของฤดูกาลทำให้ราคาผลปาล์มดิบเพิ่มขึ้น  $100 - 86.61 = 13.39$  %

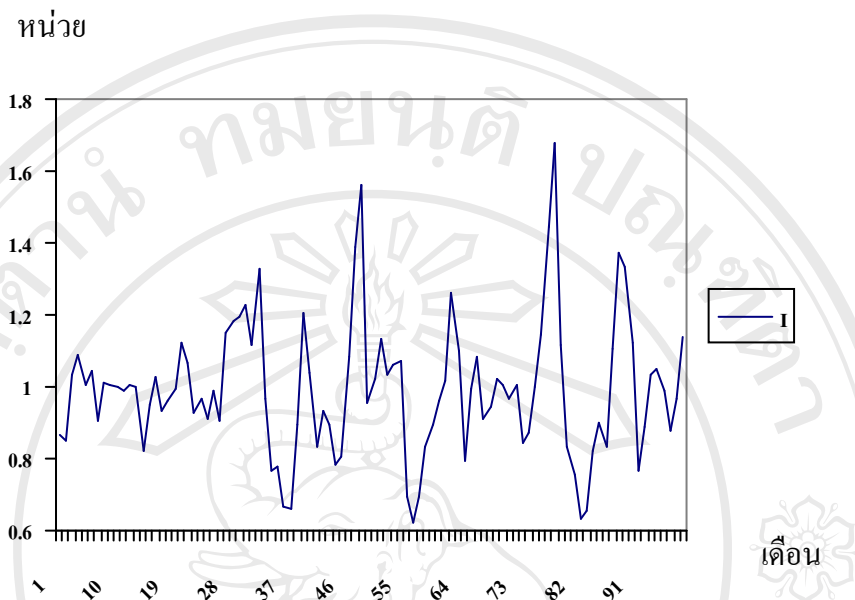
#### 4.3 การเคลื่อนไหวตามวัฏจักร (Cyclical movement: C)



รูป 4.2 ค่าการเคลื่อนไหวตามวัฏจักรของราคาผลปาล์มดิบปี พ.ศ. 2539 – ปี พ.ศ.2547

หมายเหตุ: C หมายถึง ค่าการเคลื่อนไหวตาม วัฏจักร ของราคาผลปาล์มดิบตั้งแต่กรกฎาคม 2539 – สิงหาคม 2547

#### 4.4 ความเคลื่อนไหวผิดปกติ (Irregular movement: I)



รูป 4.3 ค่าความเคลื่อนไหวผิดปกติของราคาผลปาล์มดิบ ตั้งแต่ กรกฎาคม 2539 – สิงหาคม 2547

หมายเหตุ: I หมายถึง ค่าความเคลื่อนไหวผิดปกติของราคาผลปาล์มดิบตั้งแต่ ปี พ.ศ. 2539 – ปี พ.ศ.2547

จากค่าความเคลื่อนไหวผิดปกติที่คำนวณได้ อธิบายได้ว่าค่าเคลื่อนไหวผิดปกติของราคาผลปาล์มดิบในเดือน กรกฎาคม พ.ศ. 2539 เท่ากับ 0.87 แสดงว่าราคาผลปาล์มดิบในเดือน กรกฎาคม พ.ศ. 2539 จะต่ำกว่าราคาผลปาล์มดิบเฉลี่ยรายเดือน เท่ากับ  $1 - 0.87 = 0.13$  หรือ 13% ส่วนในเดือน ธันวาคม พ.ศ. 2539 เท่ากับ 1.05 แสดงว่าราคาผลปาล์มดิบในเดือน ธันวาคม พ.ศ. 2539 จะสูงกว่าราคาผลปาล์มดิบเฉลี่ยรายเดือน เท่ากับ  $1.05 - 1 = 0.05$  หรือ 5%