

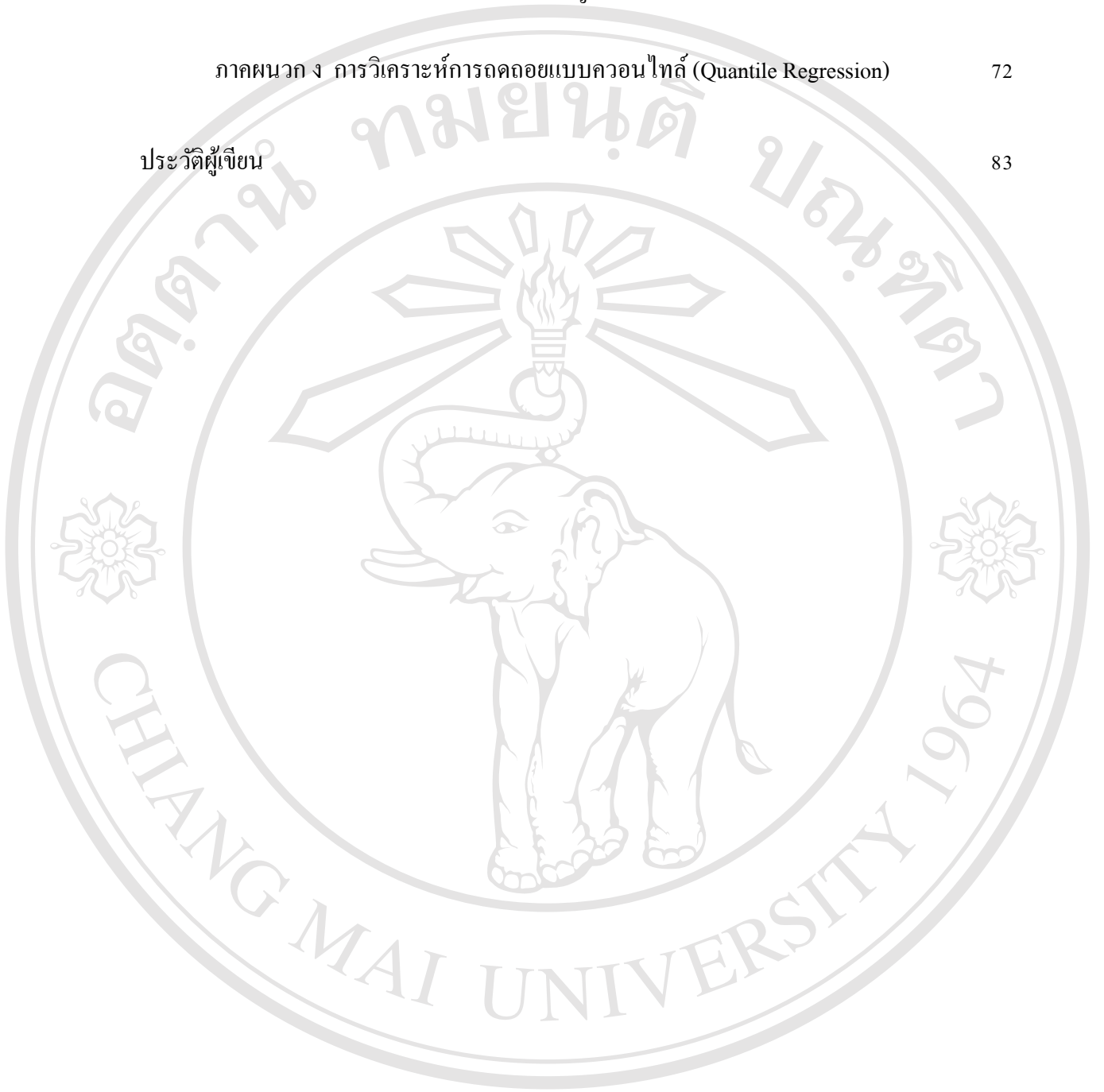
สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ฉ
สารบัญภาพ	ฉ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	8
1.3 ประโยชน์ที่ได้รับจากการศึกษา	8
1.4 ขอบเขตการศึกษา	9
1.5 นิยามศัพท์	9
บทที่ 2 แนวคิดทางทฤษฎีและผลงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	
2.1 แนวคิดทางทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง	
1) ความผันผวน (Volatility)	11
2) ความสัมพันธ์ของราคาสินค้าในตลาดซื้อขายทันทีและตลาดซื้อขายล่วงหน้า (Cash and Future Market Price Relationship)	12
3) การวิเคราะห์ประสิทธิภาพการส่งผ่านราคา	14
4) การทดสอบยูนิตรูท (Unit Root Test)	15
5) แบบจำลอง Autoregressive Integrated Moving Average Model (ARIMA)	18
6) แบบจำลองในการศึกษาความผันผวนอย่างมีเงื่อนไขแบบตัวแปรเดียว (Univariate Conditional Volatility Model)	20
7) การวิเคราะห์ข้อมูลโดยใช้วิธี Quantile Regression	24

2.2 ผลงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	25
บทที่ 3 ระเบียบวิธีวิจัย	
3.1 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	30
3.2 แบบจำลองที่ใช้ในการศึกษา	30
3.3 สมมติฐานในการศึกษา	31
3.4 วิธีการศึกษา	31
บทที่ 4 ผลการศึกษา	
4.1 ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root Test) โดยวิธี Augmented Dickey – Fuller	36
4.2 ผลการประมาณค่าความผันผวนด้วยวิธี ARIMA - GARCH	38
4.3 การวิเคราะห์การถดถอยแบบควอนไทล์ (Quantile Regression)	43
4.4 ผลการทดสอบความเท่ากันของความชันของแต่ละระดับควอนไทล์ (Quantile Slope Equality Test Result)	45
บทที่ 5 สรุปผลและข้อเสนอแนะ	
5.1 สรุปผลการศึกษา	48
5.2 ข้อเสนอแนะเชิงนโยบาย	49
5.3 ข้อเสนอแนะเพื่อใช้ในการศึกษาครั้งต่อไป	50
เอกสารอ้างอิง	52

ภาคผนวก

ภาคผนวก ก ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล (Unit Root Test) โดยวิธี Augmented Dickey-Fuller Test	56
ภาคผนวก ข ผลการทดสอบ Autoregressive Integrated Moving Average Model (ARIMA)	62
ภาคผนวก ค ผลการทดสอบ Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity (GARCH)	66



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
4.1 ผลการทดสอบ Unit Root ด้วยวิธี Augmented Dickey - Fuller (ADF)	36
4.2 ผลการทดสอบ ARCH Process ของ Residual ของราคาข้าวในตลาดซื้อขายทันที และราคาข้าวในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าของประเทศไทย	39
4.3 ผลการประมาณค่าแบบจำลอง ARIMA - GARCH ของราคาข้าวในตลาดซื้อขายทันที	39
4.4 ผลการประมาณค่าแบบจำลอง ARIMA - GARCH ของราคาข้าวในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าของประเทศไทย	41
4.5 ผลการทดสอบ ARCH Process ของ Residual ของราคาข้าวในตลาดซื้อขายทันที และราคาข้าวในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าของประเทศไทย	43
4.6 ผลการทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของราคาข้าวในตลาดซื้อขายทันทีและความผันผวนของราคาข้าวในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าของประเทศไทย	44
4.5 ผลการทดสอบความเท่ากันของความชันของแต่ละระดับควอนไทล์	46

สารบัญภาพ

รูป	หน้า
1.1 ราคาส่งออกข้าวสารไทย	2
1.2 ราคาข้าวเจ้าในปี ชนิด 5 %	3
1.3 ราคาข้าวเจ้าในปีพันธุ์ขาวดอกมะลิ 105 ชนิด 100 %	4
1.4 ราคาข้าวเหนียวในปี	4
1.5 ราคาข้าวหอมมะลิ 100% ชั้น 2 ในตลาดซื้อขายทันที	7
1.6 ราคาข้าวหอมมะลิ 100% ชั้น 2 ในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าของประเทศไทย	7

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved