

หัวข้อวิทยานิพนธ์	การวิเคราะห์ลักษณะเฉพาะพลวัตของราคายางไทยด้วยทฤษฎี สถิติสรุป	
ผู้เขียน	นางสาว เชี่ยว เทื่อง	
ปริญญา	เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต	
คณะกรรมการที่ปรึกษา	อ.ดร.นภัสต์ หาญพรชัย	อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก
	รศ.ดร.กาญจนา โชคถาวร	อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

### บทคัดย่อ

งานวิจัยนี้นำเสนอการวิเคราะห์ลักษณะเฉพาะพลวัตของราคายางธรรมชาติของไทยด้วยการใช้ทฤษฎี  
สถิติสรุป ข้อมูลรายวันจำนวน 2272 ตัวอย่างของราคายางธรรมชาติของไทยได้รับการรวบรวมตั้งแต่  
21 เมษายน 2546 ถึง 7 กรกฎาคม 2557 จากสมาคมยางไทย โดยการใช้การวิเคราะห์พีสัยที่ได้รับการ  
จัดมาตราส่วนใหม่ เลขชี้กำลังเฮิร์สต์ได้รับการกำหนดหาเป็น 0.6167 ซึ่งมีนัยยะว่าราคายางธรรมชาติ  
ของไทยเป็นกระบวนการเพอร์ซิสเท้นท์ที่เป็นบวกพร้อมกับความจำในระยะยาว โดยอาศัยเลขชี้  
กำลังเฮิร์สต์ สีของสัญญาณและสหสัมพันธ์สามารถจะได้รับการหาได้ว่าเป็นสัญญาณสีดำ และมี  
ค่า 0.1756 ตามลำดับ ยิ่งไปกว่านั้น ความจำของราคายางธรรมชาติของไทยเท่ากับ 9 วัน จากเลขชี้  
กำลังเฮิร์สต์ ราคายางธรรมชาติของไทยเป็นไปตามสมมติฐานการตลาดแบบสถิติสรุปมากกว่าที่จะ  
เป็นสมมติฐานการตลาดแบบประสิทธิภาพ

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
Copyright © by Chiang Mai University  
All rights reserved

<b>Thesis Title</b>	Dynamic Characteristic Analysis of Thai Natural Rubber Price Using Fractal Theory	
<b>Author</b>	Ms. Xiao Teng	
<b>Degree</b>	Master of Economics	
<b>Advisory Committee</b>	Lect. Dr. Napat Harnpornchai	Advisor
	Assoc. Prof. Dr. Kanchana Chokethaworn	Co-advisor

### ABSTRACT

This research presents the analysis of the dynamic characteristics of Thai natural rubber price using fractal theory. The 2272 observations of daily Thai natural rubber price are collected from 21 April 2003 to 7 July 2014, which is from Thai Rubber Association. By using the Rescaled Range Analysis, the Hurst exponent is obtained as 0.6167, which implies that the Thai natural rubber price is a positive persistent process with long-term memory. According to Hurst exponent, the color noise and the correlation can be obtained as black noise and 0.1756, respectively. Furthermore, the memory of Thai natural rubber market is yield as 9 days. From the Hurst exponent, the Thai natural rubber price follows the FMH rather than the EMH.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
Copyright© by Chiang Mai University  
All rights reserved