

หัวข้อการค้นคว้าแบบอิสระ ผลกระทบของมูลค่าการส่งออกยางล้อยานยนต์ที่มีต่อราคายางแท่ง
ของประเทศไทย โดยวิธีอาร์แมกซ์

ผู้เขียน นางสาวจารุภัทร น้ำจันทร์

ปริญญา เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการที่ปรึกษา ผศ.ดร.พัทธ์รัตน์ ภาสกร์พัฒนกุล อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก
ผศ.ดร.ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์กุล อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม

บทคัดย่อ

การค้นคว้าอิสระนี้มี 2 วัตถุประสงค์ คือ 1) เพื่อศึกษาผลกระทบของมูลค่าการส่งออกยางล้อยานยนต์ที่มีต่อราคายางแท่งของประเทศไทย 2) เพื่อพยากรณ์ราคายางแท่งของประเทศไทย โดยใช้แบบจำลองอาร์แมกซ์ (ARIMAX) ข้อมูลที่ใช้ในการวิเคราะห์เป็นข้อมูลอนุกรมเวลารายเดือน ตั้งแต่ มกราคม พ.ศ. 2549 ถึงเดือนธันวาคม พ.ศ. 2558 รวมทั้งสิ้นจำนวน 120 เดือน ข้อมูลที่ใช้ศึกษาประกอบด้วยราคายางแท่งของประเทศไทยราคาน้ำมันดิบของโลก ปริมาณการผลิตยางแท่งของประเทศไทยและมูลค่าการส่งออกยางล้อยานยนต์ของประเทศไทยการทดสอบ Unit root แบบวิธี Augmented Dickey-Fuller test (ADF) พบว่ามูลค่าการส่งออกยางล้อยานยนต์ของประเทศไทยมีค่าสถิติ ADF น้อยกว่าค่าวิกฤติที่ Order of Integration ที่อันดับ First Difference (I(1))

ผลการศึกษา พบว่า ราคาน้ำมันดิบของโลกส่งผลต่อราคายางแท่งของประเทศไทย อย่างมีนัยสำคัญทางสถิติ ที่ระดับความเชื่อมั่น 99% อย่างไรก็ตามปริมาณการผลิตยางแท่งของประเทศไทย และมูลค่าการส่งออกยางล้อยานยนต์ของประเทศไทย ไม่สามารถอธิบายราคายางแท่งของประเทศไทยได้อย่างมีนัยสำคัญหลังจากนั้นทำการพยากรณ์ข้อมูลโดยทำการพยากรณ์ล่วงหน้า เริ่มพยากรณ์ตั้งแต่เดือนพฤศจิกายน พ.ศ. 2559 ถึงเดือนเมษายน พ.ศ. 2560 พยากรณ์ล่วงหน้า 6 เดือน ผลการพยากรณ์ที่ได้คือราคายางแท่งของประเทศไทยเท่ากับ 54.5209, 56.9698, 58.6484, 60.0080, 61.2056 และ 62.2982 บาทต่อกิโลกรัม ตามลำดับ

| | | |
|--------------------------------|--|------------|
| Independent Study Title | The Impact of Automobile Tires Export Value to Block Rubber Price in Thailand by ARIMAX Method | |
| Author | Miss JaruphatNamjun | |
| Degree | Master of Economics | |
| Advisory Committee | Asst. Prof. Dr. Pathairat Pastpipatkul | Advisor |
| | Asst. Prof. Dr. Chaiwat Nimanussornkul | Co-advisor |

ABSTRACT

This study has 2 purposes including 1) to study an effect of automobile tire export value to Thai rubber price 2) to estimate Thai rubber price by ARIMAX approaching. The data that use in this research are monthly secondary data from January 2006 to December 2015, 120 observations in total. The data include Thai rubber price, crude oil price, block rubber production quantity and automobile tire export value. The study test Unit root by approaching Augmented Dickey-Fuller test (ADF) and found that all variables are stationary at First Difference (I(1)) because calculated ADF are statistically less than critical value at Order of Integration: First Difference (I(1)).

The result can be explain that crude oil price statistically influence to Thai rubber price at 99% confidence level. However, block rubber production quantity and automobile tire export value do not have any impact over Thai rubber price. Therefore, the study can forecast rubber price for 6 month periods from November 2015 to April 2016 and there are 54.5209, 56.9698, 58.6484, 60.0080, 61.2056 และ 62.2982 baht per kilogram respectively.