

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ก
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	จ
สารบัญตาราง	ฅ
สารบัญภาพ	ฉ
บทที่ 1 บทนำ	1
1.1 ที่มาและความสำคัญ	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	7
1.3 ประโยชน์ที่ได้รับจากการศึกษา	8
1.4 ขอบเขตของการศึกษา	8
1.5 นิยามศัพท์	8
บทที่ 2 แนวคิด ทฤษฎีและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	10
2.1 แนวคิดและทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง	10
2.2 เอกสารและงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	20
บทที่ 3 ระเบียบวิธีการวิจัย	25
3.1 ข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา	25
3.2 เครื่องมือที่ใช้ในการศึกษา	25
3.3 แบบจำลองและกรอบแนวคิด	25
3.4 วิธีการศึกษา	26

บทที่ 4 ผลการศึกษา	29
4.1 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล	30
4.2 การเลือกแบบจำลอง ARIMAX	31
4.3 การพยากรณ์	37
บทที่ 5 สรุปผลและข้อเสนอแนะ	39
5.1 สรุปผลการศึกษา	39
5.2 ข้อเสนอแนะ	40
เอกสารอ้างอิง	41
ภาคผนวก	44
ภาคผนวก ก ตารางการทดสอบ Unit root test	45
ภาคผนวก ข กราฟ Correlogram	57
ภาคผนวก ค แบบจำลอง ARIMAX	58
ภาคผนวก ง ผลการทดสอบปัญหาอัตสหสัมพันธ์ในตัวแปร	64
ภาคผนวก จ ผลการทดสอบ ARIMAX	65
ประวัติผู้เขียน	66

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright© by Chiang Mai University
 All rights reserved

สารบัญตาราง

	หน้า
ตารางที่ 4.1 ผลการทดสอบ Unit root test โดยวิธี Augmented Dickey-Fuller (ADF)	32
ตารางที่ 4.2 ผลการเลือกแบบจำลอง ARIMAX ที่เหมาะสม	34
ตารางที่ 4.3 ผลการคำนวณ R-squared, Adjusted R-squared และ BIC	34
ตารางที่ 4.4 ผลของการทดสอบ Serial Correlation	35
ตารางที่ 4.5 ผลการประมาณค่าจากแบบจำลอง ARIMAX	36
ตารางที่ 4.6 การพยากรณ์แบบจำลอง ARIMAX	38



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบัญภาพ

	หน้า
ภาพที่ 1.1 ปริมาณการผลิตยางธรรมชาติของประเทศต่างๆ ปี พ.ศ.2500-2558	2
ภาพที่ 1.2 ปริมาณการผลิตยางธรรมชาติของไทยจำแนกตามประเภท ปี พ.ศ. 2550 – 2558	3
ภาพที่ 1.3 สัดส่วนและมูลค่าการส่งออกผลิตภัณฑ์ยางที่สำคัญของไทย	5
ภาพที่ 1.4 มูลค่าการส่งออกยางล้อยานยนต์ของประเทศไทย ปี พ.ศ. 2552-2556	6
ภาพที่ 2.1 แสดงทฤษฎีไฮแมงมุม	15
ภาพที่ 3.1 กรอบแนวคิด	28
ภาพที่ 4.1 ผลค่า Autocorrelation Function (ACF) และค่า Partial Autocorrelation Function (PACF) เพื่อกำหนดค่า AR(p) และ MA(q)	33
ภาพที่ 4.2 กราฟเปรียบเทียบระหว่างราคายางแท่งของประเทศไทย และราคายางแท่งของประเทศไทยที่ได้จากการพยากรณ์	39
ภาพที่ 4.3 กราฟเปรียบเทียบระหว่างค่าจริงของราคายางแท่งของประเทศไทย และราคายางแท่งของประเทศไทยที่ได้จากการพยากรณ์ล่วงหน้า 6 เดือน	40

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved