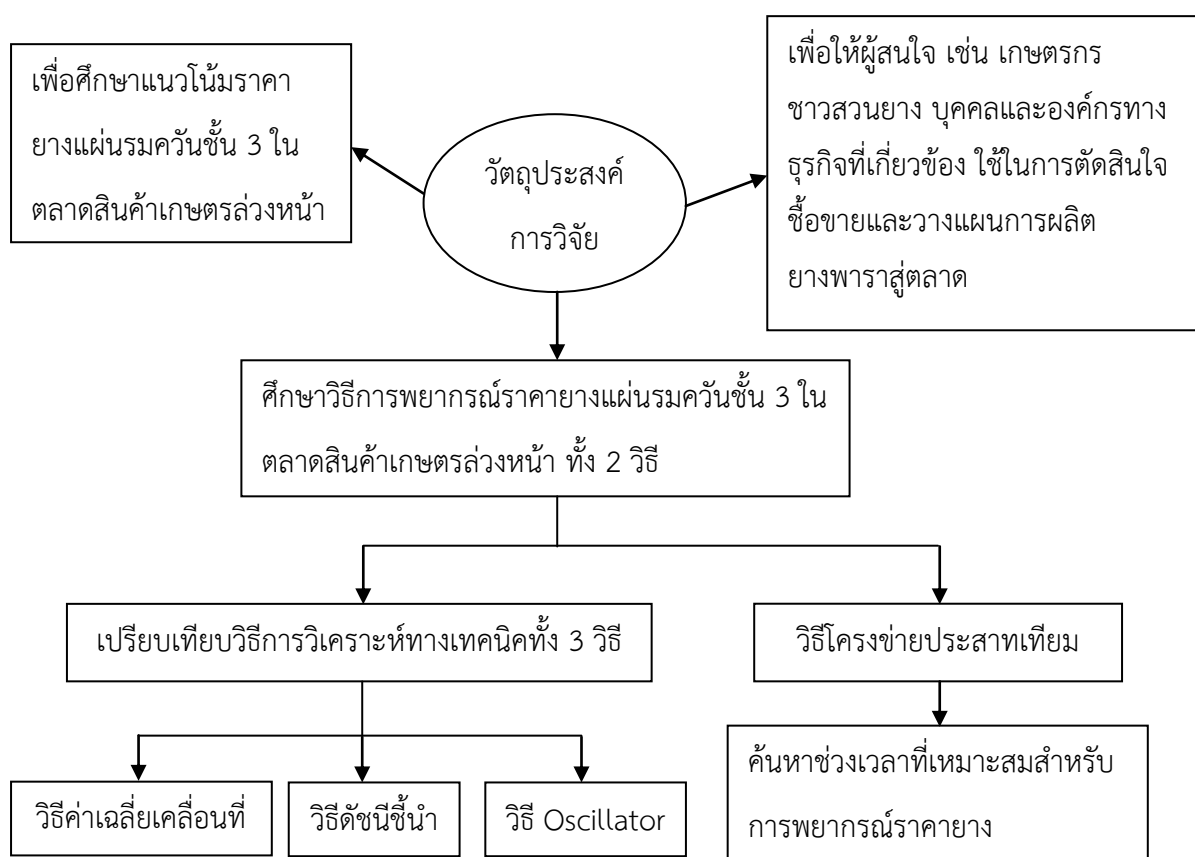


## ผลการสังเคราะห์ความรู้จากงานวิจัยหรืองานสร้างสรรค์ เพื่อให้เป็นองค์ความรู้ที่คนทั่วไปเข้าใจได้

เรื่อง : แบบจำลองเพื่อการพยากรณ์ราคาผลผลิตทางการเกษตรในตลาดการซื้อขายล่วงหน้า: กรณีศึกษา  
ยางพารา

ผู้วิจัย : อ.ชินใจ สุกปาน

### ผลการสังเคราะห์ความรู้



การศึกษาครั้งนี้ ผู้วิจัยใช้ข้อมูลอนุกรมเวลาที่เป็นข้อมูลแบบรายวันของราคายางแผ่นรมควันชั้น 3 ในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้า ซึ่งทำการเก็บรวบรวมตั้งแต่เดือนมกราคม 2548 ถึง เดือนธันวาคม 2553 (<http://www.afet.or.th,2554>) จากนั้นทำการวิเคราะห์แนวโน้มราคาของยางแผ่นรมควันชั้น 3 โดยใช้วิธีการพยากรณ์ 2 วิธี คือ วิธีการวิเคราะห์ทางเทคนิคและวิธีโครงข่ายประสาทเทียม จากการศึกษาสามารถสรุปได้ดังนี้

1. จากการวิเคราะห์แนวโน้มราคาของแผ่นรมควันชั้น 3 สำหรับต้นเดือนมกราคม 2554 เมื่อข้อมูลเป็นแบบรายวัน พบว่าราคาของแผ่นรมควันชั้น 3 มีแนวโน้มปรับตัวสูงขึ้น
2. วิธีการวิเคราะห์ทางเทคนิคทั้ง 3 วิธี คือ วิธีค่าเฉลี่ยเคลื่อนที่ วิธีดัชนีชี้แนะและวิธี Oscillator เมื่อระยะเวลาของเส้นค่าเฉลี่ยเคลื่อนที่เป็น 10 วัน 25 วันและ 75 วัน วิธีที่เหมาะสมสำหรับแต่ละวิธีการวิเคราะห์ทางเทคนิค คือ EMA OBV และ Slow Stochastic ตามลำดับ
3. ในการตรวจสอบค่าพยากรณ์จากวิธีโครงข่ายประสาทเทียม พบว่า ช่วงเวลาการพยากรณ์ที่เหมาะสมสำหรับการพยากรณ์ราคาของแผ่นรมควันชั้น 3 เมื่อข้อมูลเป็นรายวัน คือ 5 วัน

### ข้อเสนอแนะในการศึกษาครั้งต่อไป

ผู้สนใจสามารถนำความรู้ที่ได้รับไปศึกษาข้อมูลที่สำคัญทางเศรษฐกิจอื่น ๆ ของประเทศไทย ได้แก่ ข้อมูลราคาทองคำ ข้อมูลหุ้นต่างๆ ในตลาดหลักทรัพย์ เป็นต้น