

การศึกษามีวัตถุประสงค์เพื่อศึกษาปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อราคายางพาราแผ่นรมควันชั้น 3 ในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย และรูปแบบสมการพยากรณ์ราคาที่เหมาะสมในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย

ตัวอย่างในการศึกษาคือ สัญญา RU0505, RU0506, RU0507, RU0508, RU0509 และ RU0510 รวบรวมข้อมูลโดยใช้ข้อมูลทุติยภูมิจากเอกสารและเว็บไซต์ต่าง ๆ ที่เกี่ยวข้องกับวิเคราะห์ข้อมูลในเชิงสถิติ โดยใช้การวิเคราะห์การถดถอย กำลังสองน้อยที่สุด การพยากรณ์ด้วยสมการแบบจำลองที่ประมาณได้ Single Exponential Smoothing, Double Exponential Smoothing และ Hodrick-Prescott Filter การเปรียบเทียบความคลาดเคลื่อนด้วย Mean Square Error, Root Mean Square Error, Mean Average Deviation และ Mean Average Percentage Error

ผลการศึกษาสรุปได้ว่า ปัจจัยที่มีผลกระทบต่อราคายางพาราแผ่นรมควันชั้น 3 ในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทยคือ ราคายางพาราแผ่นรมควันชั้น 3 ในตลาด Tokyo Commodities Exchange (TOCOM), ราคายางพาราแผ่นรมควันชั้น 3 ในตลาดกลางภาคใหญ่, ปริมาณผลรวมการซื้อขายยางพาราแผ่นรมควันชั้น 3 ใน 3 ตลาดกลางแห่งประเทศไทย, ระยะเวลาคงเหลือก่อนวันส่งมอบวันแรก, อัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อ 1 ดอลลาร์สหรัฐ, อัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อ 100 เยน และจำนวนสัญญาคงค้าง โดยมีราคาของยางพาราแผ่นรมควันชั้น 3 ในตลาด TOCOM เป็นปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อราคาของยางพาราแผ่นรมควันชั้น 3 ในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทยทุกสัญญาที่ทำการศึกษาในครั้งนี้

สำหรับรูปแบบสมการพยากรณ์ที่เหมาะสม เพื่อหาจุดเริ่มต้นของราคาของยางพาราแผ่นรมควันชั้น 3 ในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย คือสมการแบบจำลองที่ได้จากการประมาณค่าจากสัญญา RU0506 เพราะมีค่าความคลาดเคลื่อนต่ำที่สุดเมื่อเปรียบเทียบกับสมการพยากรณ์ในรูปแบบอื่น ๆ ของทุกสัญญาที่ทำการศึกษาในครั้งนี้

This research aimed to investigate factors influencing price of ribbed smoked rubber sheet No. 3 in agricultural futures exchange of Thailand (AFET) and fitting the appropriated model in order to forecast prices of new futures contracts.

Samples for this study consist of contract RU0505, RU0506, RU0507, RU0508, RU0509, and RU0510. Secondary data was collected from various documents including information from websites. An analysis of the data was performed by using multiple regressions through least square method, single exponential smoothing, double exponential smoothing, and Hodrick-Prescott filter. The comparison of forecasting error was performed by using Mean Square Error, Root Mean Square Error, Mean Average Deviation and Mean Average Percentage Error

The results revealed that factors influencing prices of ribbed smoked rubber sheet No. 3 in AFET were price of rubber futures contracts in Tokyo Commodities Exchange (TOCOM), price of smoked rubber sheet No. 3 in Hadyai Market, summation quantity of rubber daily trade in 3 markets of Thailand, time remaining to delivery date, exchange rate 1 of USD., Japanese exchange rate, and the quantities of open contract. The price of ribbed smoked rubber sheet No. 3 in the TOCOM was the most significant factor that influenced the price of ribbed smoked rubber sheet No. 3 in AFET

The model for the starting price of futures contracts was appropriated with contract RU0506 due to minimum error in forecasting, comparing with another contracts.