

วัตถุประสงค์ของวิทยานิพนธ์ฉบับนี้ เพื่อจะศึกษาปัจจัยต่าง ๆ ที่มีผลต่อการเคลื่อนไหวของราคารายแผ่นรมควันชั้น 3 ในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย และพยากรณ์ถึงแนวโน้มของราคาที่จะเกิดขึ้นในอนาคต วิธีที่ใช้ในการศึกษา คือ วิธีทางสถิติวิเคราะห์โดยใช้สมการถดถอยวิธีกำลังสองน้อยที่สุดแบบธรรมดา ใช้ข้อมูลทุติยภูมิรายเดือนระหว่าง เดือนมกราคม พ.ศ. 2548 ถึงเดือน ธันวาคม 2550

ผลการศึกษาพบว่า ราคารายแผ่นรมควันชั้น 3 ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทยมีความสัมพันธ์กับ อัตราแลกเปลี่ยนสกุลเงินบาทต่อเยนญี่ปุ่น ราคารายแผ่นรมควันชั้น 3 ตลาดสินค้าโภคภัณฑ์โตเกียว (TOCOM) ราคารายแผ่นรมควันชั้น 3 F.O.B ท่าเรือกรุงเทพ และปริมาณการส่งออกยางธรรมชาติของประเทศไทยในทิศทางเดียวกัน ณ ระดับความสำคัญทางสถิติที่ระดับความเชื่อมั่นร้อยละ 99 ซึ่งผลการศึกษาดังกล่าวตรงกับสมมุติฐานที่ตั้งไว้ ส่วนการพยากรณ์แนวโน้มของราคารายแผ่นรมควันชั้น 3 ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย ในช่วงเดือนมกราคม พ.ศ. 2551 ถึงเดือน ธันวาคม 2551 มีแนวโน้มของราคาเพิ่มขึ้น แต่ก็มีมีความผันผวนของราคาสูง

This thesis investigates factors affecting the price of Natural Rubber Ribed Smoked Sheet (RSS) No. 3 on the Agricultural Exchange of Thailand. In addition, projected is a forecast of the trend of this price.

The method selected for investigation entailed the use of the Ordinary Least Squares method (OLS) of analytical statistics. In this connection, analyzed were relevant monthly secondary data from the period between January 2005 and December 2007.

Findings are as follows:

The price of Natural Rubber Ribed Smoked Sheet No. 3 (RSS) on The Agricultural Futures Exchange of Thailand was found to be positively correlated at the statistically significant level of reliability of 99 percent with

the baht/yen exchange rate, the price of Natural Rubber Ribed Smoked Sheet No.3 (RSS) on the Tokyo Commodity Exchange (TOCOM), the price of Natural Rubber Ribed Smoked Sheet No. 3 (RSS) Freight on Board (F.O.B.) at the port of Bangkok, and the volume of exports of natural rubber from Thailand. These findings were congruent with the set hypothesis postulated for the thesis.

Regarding the forecast of the trend of the price of Natural Rubber Ribed Smoked Sheet No. 3 (RSS) on The Agricultural Futures Exchange of Thailand in the period between January 2008 and December 2008, the researcher determined that there was a tendency for the price to increase. However, it was also found that there was a high degree of price fluctuation in this connection.