

สุวิทย์ สิริตปนิยะ 2553: แบบจำลองการพยากรณ์เงินฝากและเงินให้กู้: กรณีศึกษา
สหกรณ์ออมทรัพย์พนักงานการประปานครหลวง จำกัด ปริญาศิลปศาสตรมหาบัณฑิต
(เศรษฐศาสตร์สหกรณ์) สาขาเศรษฐศาสตร์สหกรณ์ ภาควิชาสหกรณ์
อาจารย์ที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์หลัก: อาจารย์พรชัย สุภวิทพัฒนา, Ph.D. 127 หน้า

การศึกษานี้มีวัตถุประสงค์เพื่อพยากรณ์เงินฝากและเงินให้กู้ ของสหกรณ์ออมทรัพย์
พนักงานการประปานครหลวง จำกัด โดยเปรียบเทียบวิธีการพยากรณ์สองประเภทคือ วิธีการ
พยากรณ์โดยวิธีการพยากรณ์เดี่ยว 3 แบบ คือ วิธีการพยากรณ์แบบวิธีเฉลี่ยเคลื่อนที่สองครั้ง วิธี
ปรับให้เรียบแบบเอ็กซ์โปเนนเชียล 2 ครั้งแบบ โฮลต์ และวิธีการพยากรณ์แบบบอกซ์-เจนกินส์ วิธีการ
พยากรณ์อีกประเภทคือพยากรณ์รวม 3 แบบ คือ วิธีการพยากรณ์รวมแบบถ่วงน้ำหนักเท่ากัน
วิธีการพยากรณ์รวมแบบถ่วงน้ำหนักต่างกัน และวิธีการพยากรณ์รวมวิธีวิเคราะห์การถดถอย โดย
เปรียบเทียบความถูกต้องของแบบจำลองการพยากรณ์แบบต่างๆด้วยค่าเฉลี่ยความคลาดเคลื่อนยก
กำลังสอง (Mean Square Error : MSE) ที่ต่ำที่สุด

พบว่าวิธีการพยากรณ์ที่เหมาะสมสำหรับอนุกรมเวลาแต่ละประเภทนั้น มีความเหมาะสม
ในการพยากรณ์ด้วยวิธีที่แตกต่างกันคือ อนุกรมเวลาเงินฝากออมทรัพย์ เงินฝากออมทรัพย์พิเศษ
เหมาะสมกับการพยากรณ์ด้วยวิธีการพยากรณ์รวมวิธีวิเคราะห์การถดถอย เงินฝากประจำและ
เงินกู้สามัญ เหมาะสมกับการพยากรณ์ด้วยวิธีการพยากรณ์แบบบอกซ์-เจนกินส์ เงินให้กู้ฉุกเฉิน
เหมาะสมกับการพยากรณ์ด้วยวิธีการพยากรณ์รวมแบบถ่วงน้ำหนักต่างกัน และเงินให้กู้พิเศษ
เหมาะสมกับการพยากรณ์ด้วยวิธีการพยากรณ์แบบโฮลต์