

ภาคผนวก

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

ภาคผนวก ก
แสดงข้อมูลที่ใช้ในการศึกษา

ข้อมูลอนุกรมเวลาราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควันชั้น 3 เดือนกันยายน พ.ศ. 2548

	วันที่	ราคา		วันที่	ราคา		วันที่	ราคา
1	2/25/2005	50.5	24	3/30/2005	50.7	47	5/10/2005	50.6
2	2/28/2005	50.7	25	3/31/2005	50.6	48	5/11/2005	50.6
3	3/1/2005	50.5	26	4/1/2005	50.9	49	5/12/2005	50.4
4	3/2/2005	50.7	27	4/4/2005	50.8	50	5/13/2005	50.5
5	3/3/2005	50.6	28	4/5/2005	51.1	51	5/16/2005	50.8
6	3/4/2005	50.7	29	4/7/2005	50.8	52	5/17/2005	50.7
7	3/7/2005	50.5	30	4/8/2005	50.6	53	5/18/2005	51.2
8	3/8/2005	50.4	31	4/11/2005	50.4	54	5/19/2005	51.1
9	3/9/2005	50.4	32	4/12/2005	50.5	55	5/20/2005	51
10	3/10/2005	50.3	33	4/18/2005	50.3	56	5/24/2005	52.1
11	3/11/2005	50.1	34	4/19/2005	50.2	57	5/25/2005	52.2
12	3/14/2005	50.3	35	4/20/2005	50.4	58	5/26/2005	52.7
13	3/15/2005	50.4	36	4/21/2005	50.4	59	5/27/2005	52.7
14	3/16/2005	50.1	37	4/22/2005	50.3	60	5/30/2005	52.8
15	3/17/2005	50.4	38	4/25/2005	50.3	61	5/31/2005	53.3
16	3/18/2005	50.3	39	4/26/2005	50.2	62	6/1/2005	53.1
17	3/21/2005	50.1	40	4/27/2005	50.3	63	6/2/2005	53.9
18	3/22/2005	49.9	41	4/28/2005	50.1	64	6/3/2005	54.2
19	3/23/2005	49.9	42	4/29/2005	50.1	65	6/6/2005	55.5
20	3/24/2005	50.1	43	5/3/2005	50.2	66	6/7/2005	56.2
21	3/25/2005	49.9	44	5/4/2005	50.3	67	6/8/2005	55.3
22	3/28/2005	50	45	5/6/2005	50.3	68	6/9/2005	54.3
23	3/29/2005	50.3	46	5/9/2005	50.6	69	6/10/2005	54.7

ตาราง(ต่อ)

	วันที่	ราคา		วันที่	ราคา		วันที่	ราคา
70	6/13/2005	54.5	88	7/8/2005	63.9	106	8/4/2005	66.8
71	6/14/2005	55.5	89	7/11/2005	64.6	107	8/5/2005	66.8
72	6/15/2005	55	90	7/12/2005	66.5	108	8/8/2005	66.8
73	6/16/2005	54.7	91	7/13/2005	66.5	109	8/9/2005	64.6
74	6/17/2005	54.9	92	7/14/2005	68.4	110	8/10/2005	61.9
75	6/20/2005	54.9	93	7/15/2005	69.8	111	8/11/2005	61.9
76	6/21/2005	54.9	94	7/18/2005	70.7	112	8/15/2005	59.7
77	6/22/2005	55.1	95	7/19/2005	72.6	113	8/16/2005	60.7
78	6/23/2005	55.6	96	7/20/2005	72.6	114	8/17/2005	60.7
79	6/24/2005	57.1	97	7/21/2005	72.6	115	8/18/2005	60.7
80	6/27/2005	57.8	98	7/25/2005	73	116	8/19/2005	60.7
81	6/28/2005	59.1	99	7/26/2005	72.7	117	8/22/2005	62.9
82	6/29/2005	59.6	100	7/27/2005	70.8	118	8/23/2005	62.9
83	6/30/2005	59.7	101	7/28/2005	69.6	119	8/24/2005	62.9
84	7/4/2005	60.7	102	7/29/2005	70.7	120	8/25/2005	63.3
85	7/5/2005	61.3	103	8/1/2005	71.2	121	8/26/2005	63.3
86	7/6/2005	63.2	104	8/2/2005	69	122	8/29/2005	64
87	7/7/2005	65.1	105	8/3/2005	69			

ข้อมูลอนุกรมเวลาราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควันชั้น 3 เดือนตุลาคม ปี 2548

	วันที่	ราคา		วันที่	ราคา		วันที่	ราคา
1	3/30/2005	50.7	28	5/16/2005	50.7	55	6/23/2005	55
2	3/31/2005	50.7	29	5/17/2005	50.6	56	6/24/2005	56
3	4/1/2005	50.9	30	5/18/2005	50.8	57	6/27/2005	56.9
4	4/4/2005	50.8	31	5/19/2005	50.8	58	6/28/2005	58
5	4/5/2005	51.1	32	5/20/2005	50.7	59	6/29/2005	58.4
6	4/7/2005	50.8	33	5/24/2005	51.7	60	6/30/2005	58.2
7	4/8/2005	50.6	34	5/25/2005	51.7	61	7/4/2005	59
8	4/11/2005	50.3	35	5/26/2005	52.2	62	7/5/2005	59.7
9	4/12/2005	50.5	36	5/27/2005	52.3	63	7/6/2005	61.6
10	4/18/2005	50.3	37	5/30/2005	52.2	64	7/7/2005	63.5
11	4/19/2005	50.2	38	5/31/2005	52.3	65	7/8/2005	61.9
12	4/20/2005	50.4	39	6/1/2005	52	66	7/11/2005	62.5
13	4/21/2005	50.3	40	6/2/2005	52.8	67	7/12/2005	64.4
14	4/22/2005	50.3	41	6/3/2005	53.4	68	7/13/2005	64.7
15	4/25/2005	50.3	42	6/6/2005	54.9	69	7/14/2005	66.1
16	4/26/2005	50.2	43	6/7/2005	55.7	70	7/15/2005	67.7
17	4/27/2005	50.4	44	6/8/2005	54.3	71	7/18/2005	69.1
18	4/28/2005	50.1	45	6/9/2005	53.5	72	7/19/2005	71
19	4/29/2005	50	46	6/10/2005	54	73	7/20/2005	71.3
20	5/3/2005	50.2	47	6/13/2005	53.9	74	7/21/2005	71.3
21	5/4/2005	50.3	48	6/14/2005	54.9	75	7/25/2005	72.1
22	5/6/2005	50.2	49	6/15/2005	54.4	76	7/26/2005	71.8
23	5/9/2005	50.6	50	6/16/2005	54	77	7/27/2005	69.9
24	5/10/2005	50.6	51	6/17/2005	54.1	78	7/28/2005	68.7
25	5/11/2005	50.4	52	6/20/2005	54.1	79	7/29/2005	69.8
26	5/12/2005	50.4	53	6/21/2005	54	80	8/1/2005	70.3
27	5/13/2005	50.4	54	6/22/2005	54.2	81	8/2/2005	68.1

ตาราง(ต่อ)

	วันที่	ราคา
82	8/3/2005	67.7
83	8/4/2005	65.5
84	8/5/2005	65
85	8/8/2005	65
86	8/9/2005	62.8
87	8/10/2005	60.1
88	8/11/2005	60.1
89	8/15/2005	58
90	8/16/2005	59.6
91	8/17/2005	59.2
92	8/18/2005	60
93	8/19/2005	60
94	8/22/2005	62.1

	วันที่	ราคา
95	8/23/2005	62.1
96	8/24/2005	62.1
97	8/25/2005	62.5
98	8/26/2005	62.5
99	8/29/2005	64
100	8/30/2005	64
101	8/31/2005	66.2
102	9/1/2005	66.2
103	9/2/2005	66.2
104	9/5/2005	68.4
105	9/6/2005	70
106	9/7/2005	70
107	9/8/2005	70

	วันที่	ราคา
108	9/9/2005	70
109	9/13/2005	67.5
110	9/14/2005	67.5
111	9/15/2005	68
112	9/16/2005	68
113	9/19/2005	68
114	9/20/2005	69.6
115	9/21/2005	69.6
116	9/22/2005	69.6
117	9/23/2005	69.3
118	9/26/2005	67.3
119	9/27/2005	69
120	9/28/2005	68.5

ข้อมูลอนุกรมเวลาราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควันชั้น 3 เดือนพฤศจิกายน ปี 2548

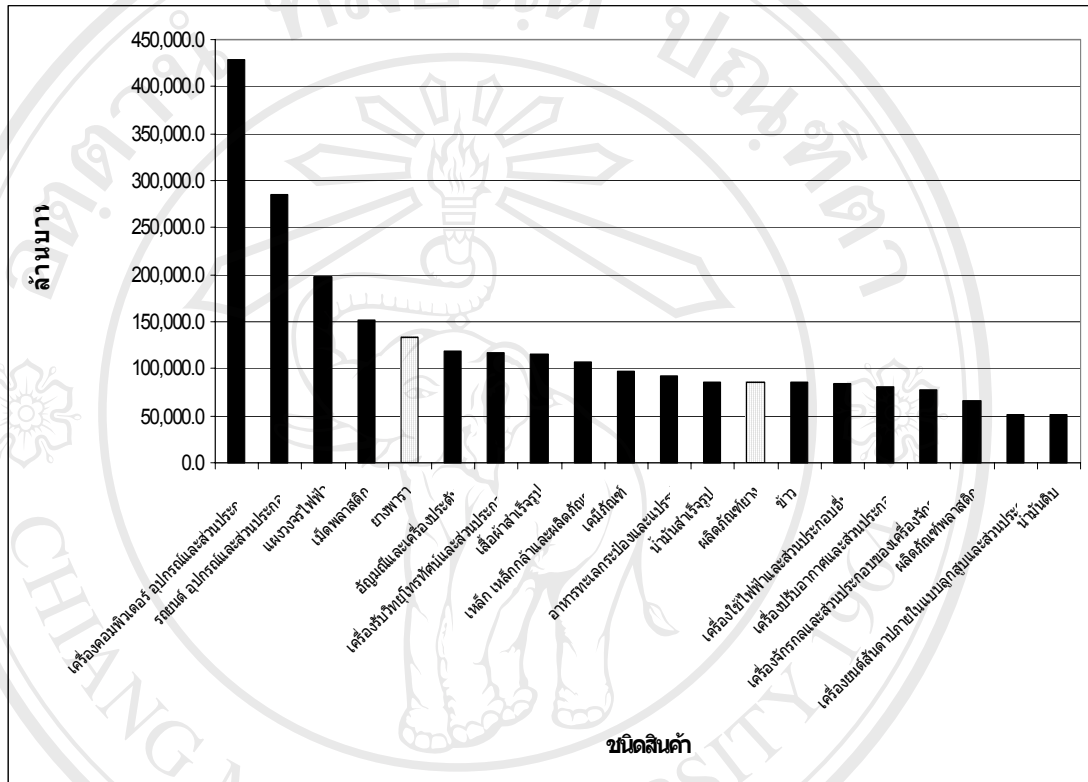
	วันที่	ราคา		วันที่	ราคา		วันที่	ราคา
1	4/28/2005	50.1	28	6/9/2005	53.1	55	7/19/2005	70.1
2	4/29/2005	50.1	29	6/10/2005	53.8	56	7/20/2005	70.1
3	5/3/2005	50.2	30	6/13/2005	53.5	57	7/21/2005	70
4	5/4/2005	50.2	31	6/14/2005	54.4	58	7/25/2005	71
5	5/6/2005	50.2	32	6/15/2005	54.2	59	7/26/2005	70.8
6	5/9/2005	50.5	33	6/16/2005	53.9	60	7/27/2005	68.9
7	5/10/2005	50.5	34	6/17/2005	53.9	61	7/28/2005	67.7
8	5/11/2005	50.4	35	6/20/2005	53.9	62	7/29/2005	68.8
9	5/12/2005	50.3	36	6/21/2005	53.8	63	8/1/2005	69.3
10	5/13/2005	50.5	37	6/22/2005	54.1	64	8/2/2005	67.1
11	5/16/2005	50.6	38	6/23/2005	55	65	8/3/2005	66.4
12	5/17/2005	50.6	39	6/24/2005	55.8	66	8/4/2005	64.2
13	5/18/2005	50.8	40	6/27/2005	56.4	67	8/5/2005	64
14	5/19/2005	50.7	41	6/28/2005	57.4	68	8/8/2005	63
15	5/20/2005	50.7	42	6/29/2005	57.7	69	8/9/2005	60.8
16	5/24/2005	51.7	43	6/30/2005	57.5	70	8/10/2005	58.1
17	5/25/2005	51.5	44	7/4/2005	58.3	71	8/11/2005	59.4
18	5/26/2005	51.8	45	7/5/2005	58.9	72	8/15/2005	57.5
19	5/27/2005	51.9	46	7/6/2005	60.8	73	8/16/2005	59.2
20	5/30/2005	51.9	47	7/7/2005	62.7	74	8/17/2005	59.2
21	5/31/2005	52	48	7/8/2005	61.1	75	8/18/2005	60
22	6/1/2005	51.9	49	7/11/2005	61.5	76	8/19/2005	60
23	6/2/2005	52.6	50	7/12/2005	63.4	77	8/22/2005	62.2
24	6/3/2005	53.2	51	7/13/2005	63.6	78	8/23/2005	62.6
25	6/6/2005	54.7	52	7/14/2005	65.1	79	8/24/2005	63
26	6/7/2005	55.6	53	7/15/2005	66.8	80	8/25/2005	63
27	6/8/2005	54.2	54	7/18/2005	68.2	81	8/26/2005	62.1

ตาราง(ต่อ)

	วันที่	ราคา		วันที่	ราคา		วันที่	ราคา
82	8/29/2005	63.3	96	9/19/2005	66.9	110	10/7/2005	69.2
83	8/30/2005	63.3	97	9/20/2005	68.5	111	10/10/2005	69.9
84	8/31/2005	65.5	98	9/21/2005	68.5	112	10/11/2005	70.5
85	9/1/2005	65.5	99	9/22/2005	69.5	113	10/12/2005	70.8
86	9/2/2005	65.9	100	9/23/2005	68.2	114	10/13/2005	70.4
87	9/5/2005	68.1	101	9/26/2005	66.8	115	10/14/2005	69.8
88	9/6/2005	70	102	9/27/2005	66.8	116	10/17/2005	69.8
89	9/7/2005	68	103	9/28/2005	66.8	117	10/18/2005	69.8
90	9/8/2005	70	104	9/29/2005	68	118	10/19/2005	69.2
91	9/9/2005	70	105	9/30/2005	68	119	10/20/2005	68.5
92	9/13/2005	66.9	106	10/3/2005	69.2	120	10/21/2005	68.5
93	9/14/2005	66.9	107	10/4/2005	69.2	121	10/25/2005	68.5
94	9/15/2005	66.9	108	10/5/2005	69.2	122	10/26/2005	68.5
95	9/16/2005	66.9	109	10/6/2005	69.2	123	10/27/2005	67

ภาคผนวก ข

มูลค่าการส่งออกสินค้าของประเทศไทยตั้งแต่เดือนมกราคม ถึง พฤศจิกายน พ.ศ.2548



ที่มา : ศูนย์เทคโนโลยีสารสนเทศ และการสื่อสาร (2548)

ภาคผนวก ค

ค่าสถิติการทดสอบ Unit Root

ราคาสัญญาณล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควันชั้น 3 เดือนกันยายน ข้อมูลรายวัน
(ระดับ 1st Difference) ปราศจากจุดตัดแกนและแนวโน้ม

ADF Test Statistic	-3.793	1% Critical Value*	-2.583
		5% Critical Value	-1.943
		10% Critical Value	-1.6173

*MacKinnon critical values for rejection of hypothesis of a unit root.

Augmented Dickey-Fuller Test Equation

Dependent Variable: D(DSEP,2)

Method: Least Squares

Date: 04/08/06 Time: 14:55

Sample(adjusted): 5 121

Included observations: 117 after adjusting endpoints

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
D(DSEP(-1))	-0.475	0.125	-3.793	0.000
D(DSEP(-1),2)	-0.385	0.116	-3.326	0.001
D(DSEP(-2),2)	-0.257	0.091	-2.838	0.005

R-squared	0.446	Mean dependent var	-0.002
Adjusted R-squared	0.436	S.D. dependent var	1.024
S.E. of regression	0.769	Akaike info criterion	2.338
Sum squared resid	67.401	Schwarz criterion	2.408
Log likelihood	-133.752	F-statistic	45.836
Durbin-Watson stat	2.027	Prob(F-statistic)	0.000

ที่มา : จากการคำนวณ

สัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควันชั้น 3 เดือนตุลาคม ข้อมูลรายวัน
(ระดับ 1st Difference) ปราสจากจุดตัดแกนและแนวโน้ม

ADF Test Statistic	-4.295	1% Critical Value*	-2.583
		5% Critical Value	-1.943
		10% Critical Value	-1.617

*MacKinnon critical values for rejection of hypothesis of a unit root.

Augmented Dickey-Fuller Test Equation

Dependent Variable: D(DOTC,2)

Method: Least Squares

Date: 04/10/06 Time: 10:12

Sample(adjusted): 5 120

Included observations: 116 after adjusting endpoints

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
D(DOTC(-1))	-0.576	0.134	-4.295	0.000
D(DOTC(-1),2)	-0.294	0.121	-2.428	0.017
D(DOTC(-2),2)	-0.173	0.097	-1.792	0.076
R-squared	0.438	Mean dependent var		-0.003
Adjusted R-squared	0.428	S.D. dependent var		1.262
S.E. of regression	0.955	Akaike info criterion		2.770
Sum squared resid	102.961	Schwarz criterion		2.842
Log likelihood	-157.681	F-statistic		43.954
Durbin-Watson stat	2.008	Prob(F-statistic)		0.000

ที่มา : จากการคำนวณ

ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควันชั้น 3 เดือนพฤศจิกายน ข้อมูลรายวัน
(ระดับ 1st Difference) ปราสจากจุดตัดแกนและแนวโน้ม

ADF Test Statistic	-9.587	1% Critical Value*	-2.583
		5% Critical Value	-1.943
		10% Critical Value	-1.617

*MacKinnon critical values for rejection of hypothesis of a unit root.

Augmented Dickey-Fuller Test Equation

Dependent Variable: D(DNOV,2)

Method: Least Squares

Date: 04/10/06 Time: 10:53

Sample(adjusted): 3 123

Included observations: 121 after adjusting endpoints

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
D(DNOV(-1))	-0.876	0.091	-9.587	0.000
R-squared	0.434	Mean dependent var		-0.012
Adjusted R-squared	0.434	S.D. dependent var		1.379
S.E. of regression	1.038	Akaike info criterion		2.920
Sum squared resid	129.189	Schwarz criterion		2.943
Log likelihood	-175.654	Durbin-Watson stat		2.010

ที่มา : จากการคำนวณ

ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควันชั้น 3 เดือนกันยายน ข้อมูลรายสัปดาห์
(ระดับ 1st Difference) ปราสจากจุดตัดแกนและแนวโน้ม

ADF Test Statistic	-3.230	1% Critical Value*	-2.670
		5% Critical Value	-1.957
		10% Critical Value	-1.623

*MacKinnon critical values for rejection of hypothesis of a unit root.

Augmented Dickey-Fuller Test Equation

Dependent Variable: D(WSEP,2)

Method: Least Squares

Date: 04/10/06 Time: 11:12

Sample(adjusted): 4 26

Included observations: 23 after adjusting endpoints

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
D(WSEP(-1))	-0.550	0.170	-3.230	0.004
D(WSEP(-1),2)	-0.609	0.239	2.543	0.019
R-squared	0.365	Mean dependent var		0.113
Adjusted R-squared	0.334	S.D. dependent var		2.072
S.E. of regression	1.690	Akaike info criterion		3.971
Sum squared resid	60.011	Schwarz criterion		4.070
Log likelihood	-43.664	F-statistic		12.049
Durbin-Watson stat	2.078	Prob(F-statistic)		0.002

ที่มา: จากการคำนวณ

ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควันชั้น 3 เดือนตุลาคม ข้อมูลรายสัปดาห์
(ระดับ 1st Difference) ปราสจากจุดตัดแกนและแนวโน้ม

ADF Test Statistic	-3.845	1% Critical Value*	-2.670
		5% Critical Value	-1.957
		10% Critical Value	-1.623

*MacKinnon critical values for rejection of hypothesis of a unit root.

Augmented Dickey-Fuller Test Equation

Dependent Variable: D(WOTC,2)

Method: Least Squares

Date: 04/10/06 Time: 11:26

Sample(adjusted): 5 27

Included observations: 23 after adjusting endpoints

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
D(WOTC(-1))	-0.886	0.230	-3.845	0.001
D(WOTC(-1),2)	0.369	0.211	1.748	0.096
D(WOTC(-2),2)	0.493	0.210	2.345	0.029
R-squared	0.433	Mean dependent var		-0.037
Adjusted R-squared	0.377	S.D. dependent var		2.724
S.E. of regression	2.151	Akaike info criterion		4.491
Sum squared resid	92.516	Schwarz criterion		4.639
Log likelihood	-48.642	F-statistic		7.646
Durbin-Watson stat	1.912	Prob(F-statistic)		0.003

ที่มา : จากการคำนวณ

ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควันชั้น 3 เดือนพฤศจิกายน ข้อมูลรายสัปดาห์
(ระดับ 1st Difference) ปราสจากจุดตัดแกนและแนวโน้ม

ADF Test Statistic	-3.174	1% Critical Value*	-2.660
		5% Critical Value	-1.955
		10% Critical Value	-1.623

*MacKinnon critical values for rejection of hypothesis of a unit root.

Augmented Dickey-Fuller Test Equation

Dependent Variable: D(WNOV,2)

Method: Least Squares

Date: 04/10/06 Time: 11:40

Sample(adjusted): 3 27

Included observations: 25 after adjusting endpoints

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
D(WNOV(-1))	-0.595	0.188	-3.174	0.004
R-squared	0.295	Mean dependent var		-0.050
Adjusted R-squared	0.295	S.D. dependent var		2.867
S.E. of regression	2.4067	Akaike info criterion		4.634
Sum squared resid	139.013	Schwarz criterion		4.682
Log likelihood	-56.920	Durbin-Watson stat		1.917

ที่มา : จากการคำนวณ

ภาคผนวก ง

แสดงคอเรลโลแกรมของ Unit Root

ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนกันยายน ข้อมูลรายวัน (ระดับ Level)

Date: 04/08/06 Time: 14:49

Sample: 1 121

Included observations: 121

	Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob
1	0.987	0.987	120.90	0.000		
2	0.972	-0.109	239.09	0.000		
3	0.954	-0.095	353.98	0.000		
4	0.933	-0.142	464.71	0.000		
5	0.909	-0.073	570.81	0.000		
6	0.886	0.021	672.32	0.000		
7	0.858	-0.142	768.46	0.000		
8	0.832	0.063	859.54	0.000		
9	0.803	-0.077	945.29	0.000		
10	0.775	0.014	1025.8	0.000		
11	0.743	-0.161	1100.4	0.000		
12	0.712	0.048	1169.6	0.000		
13	0.677	-0.129	1232.8	0.000		
14	0.640	-0.096	1289.9	0.000		
15	0.606	0.147	1341.5	0.000		
16	0.572	-0.049	1387.9	0.000		
17	0.536	-0.046	1428.9	0.000		
18	0.502	0.072	1465.4	0.000		
19	0.468	-0.086	1497.3	0.000		
20	0.436	0.127	1525.2	0.000		
21	0.407	0.084	1549.9	0.000		
22	0.376	-0.169	1571.2	0.000		
23	0.345	-0.036	1589.2	0.000		
24	0.314	-0.026	1604.4	0.000		
25	0.283	-0.009	1616.8	0.000		
26	0.254	0.072	1626.9	0.000		
27	0.226	-0.033	1635.0	0.000		
28	0.199	0.004	1641.3	0.000		
29	0.173	0.032	1646.2	0.000		
30	0.148	-0.030	1649.8	0.000		
31	0.125	-0.021	1652.4	0.000		
32	0.102	-0.017	1654.1	0.000		
33	0.080	-0.042	1655.2	0.000		
34	0.058	0.047	1655.0	0.000		

ที่มา : จากการคำนวณ

คอเรโลแกรม ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนกันยายน

ข้อมูลรายวัน (1st Difference)

Date: 04/17/06 Time: 13:55

Sample: 1 121

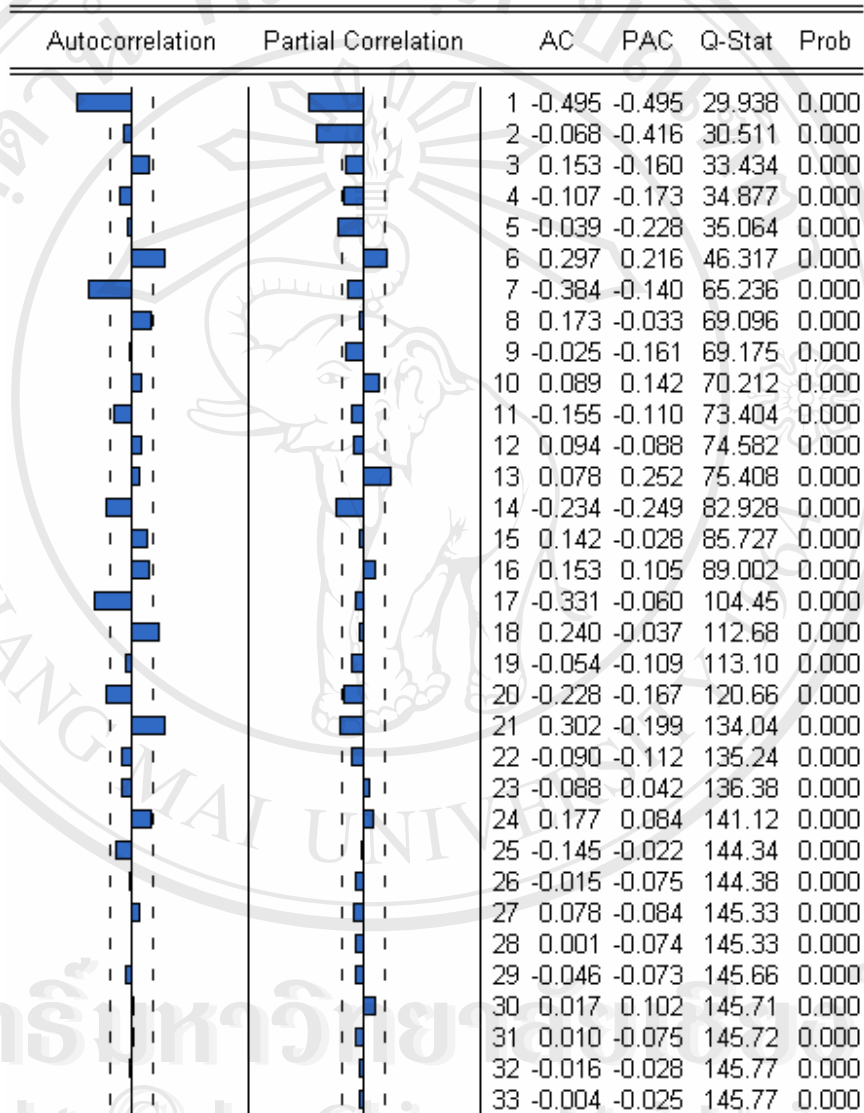
Included observations: 120

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
		1	0.210	0.210	5.4240	0.020
		2	0.203	0.167	10.562	0.005
		3	0.304	0.251	22.109	0.000
		4	0.162	0.050	25.421	0.000
		5	0.193	0.089	30.145	0.000
		6	0.281	0.169	40.321	0.000
		7	-0.099	-0.278	41.597	0.000
		8	0.126	0.063	43.670	0.000
		9	0.080	-0.034	44.517	0.000
		10	0.069	0.097	45.147	0.000
		11	-0.080	-0.208	46.006	0.000
		12	0.012	0.032	46.026	0.000
		13	-0.043	0.020	46.274	0.000
		14	-0.218	-0.334	52.849	0.000
		15	-0.023	0.157	52.925	0.000
		16	-0.056	-0.042	53.368	0.000
		17	-0.328	-0.194	68.620	0.000
		18	-0.080	-0.042	69.534	0.000
		19	-0.208	-0.059	75.806	0.000
		20	-0.250	0.017	84.923	0.000
		21	0.065	0.090	85.557	0.000
		22	-0.098	0.143	86.979	0.000
		23	-0.117	0.070	89.041	0.000
		24	0.004	-0.084	89.043	0.000
		25	-0.156	-0.135	92.799	0.000
		26	-0.086	-0.034	93.956	0.000
		27	0.010	0.023	93.971	0.000
		28	-0.018	0.039	94.021	0.000
		29	-0.046	0.032	94.363	0.000
		30	-0.002	0.034	94.364	0.000
		31	0.012	-0.144	94.389	0.000
		32	0.013	0.027	94.417	0.000
		33	0.038	-0.012	94.657	0.000

ที่มา: จากการคำนวณ

คอเรโลแกรม ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนกันยายน
ข้อมูลรายวัน (2nd Difference)

Date: 04/17/06 Time: 13:57
Sample: 1 121
Included observations: 119



ที่มา : จากการคำนวณ

คอเรโลแกรม ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนตุลาคม

ข้อมูลรายวัน (ระดับ Level)

Date: 04/17/06 Time: 14:09
Sample: 1 120
Included observations: 120

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
		1	0.980	0.980	118.20	0.000
		2	0.957	-0.104	231.74	0.000
		3	0.933	-0.013	340.62	0.000
		4	0.903	-0.175	443.43	0.000
		5	0.870	-0.038	539.87	0.000
		6	0.836	-0.083	629.54	0.000
		7	0.797	-0.071	711.93	0.000
		8	0.761	0.040	787.62	0.000
		9	0.724	-0.022	856.76	0.000
		10	0.684	-0.069	919.08	0.000
		11	0.645	-0.001	975.03	0.000
		12	0.607	-0.011	1025.0	0.000
		13	0.566	-0.080	1068.8	0.000
		14	0.526	0.007	1107.0	0.000
		15	0.489	0.055	1140.4	0.000
		16	0.454	0.019	1169.4	0.000
		17	0.423	0.072	1194.8	0.000
		18	0.399	0.146	1217.6	0.000
		19	0.377	0.021	1238.3	0.000
		20	0.360	0.041	1257.2	0.000
		21	0.347	0.030	1275.0	0.000
		22	0.333	-0.060	1291.5	0.000
		23	0.322	-0.006	1307.1	0.000
		24	0.312	-0.031	1322.0	0.000
		25	0.303	0.028	1336.1	0.000
		26	0.295	-0.026	1349.7	0.000
		27	0.288	-0.044	1362.7	0.000
		28	0.283	0.087	1375.5	0.000
		29	0.279	-0.049	1388.0	0.000
		30	0.275	-0.039	1400.3	0.000
		31	0.269	-0.037	1412.3	0.000
		32	0.264	-0.001	1423.8	0.000
		33	0.254	-0.118	1434.7	0.000

ที่มา : จากการคำนวณ

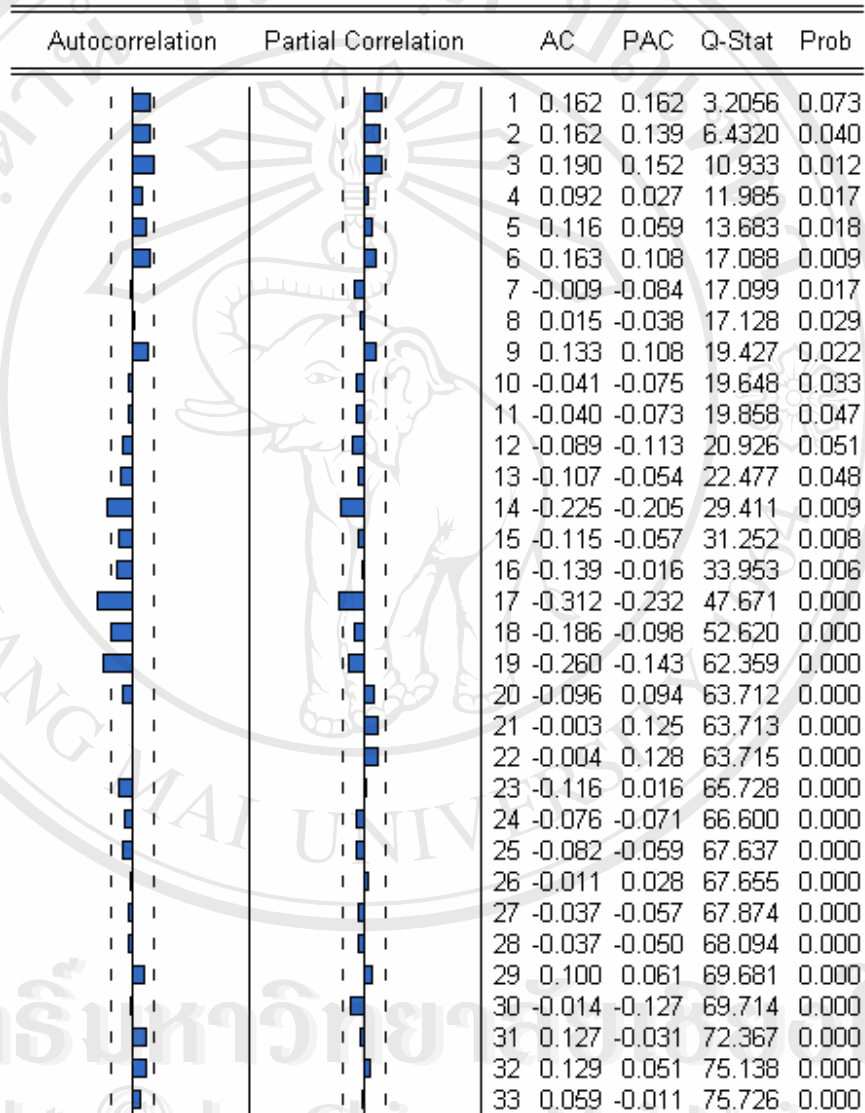
คอเรลโดแกรม ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนตุลาคม

ข้อมูลรายวัน (1st Difference)

Date: 04/17/06 Time: 14:11

Sample: 1 120

Included observations: 119



ที่มา : จากการคำนวณ

คอเรโลแกรม ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนตุลาคม
ข้อมูลรายวัน (2nd Difference)

Date: 04/17/06 Time: 14:12

Sample: 1 120

Included observations: 118

	Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob
1	-0.493	-0.493	29.430	0.000		
2	-0.031	-0.362	29.544	0.000		
3	0.082	-0.177	30.381	0.000		
4	-0.073	-0.179	31.043	0.000		
5	-0.014	-0.196	31.067	0.000		
6	0.137	0.014	33.454	0.000		
7	-0.123	-0.041	35.385	0.000		
8	-0.056	-0.172	35.792	0.000		
9	0.176	0.018	39.814	0.000		
10	-0.106	0.004	41.288	0.000		
11	0.021	0.021	41.347	0.000		
12	-0.010	-0.042	41.361	0.000		
13	0.060	0.101	41.846	0.000		
14	-0.136	-0.065	44.372	0.000		
15	0.086	-0.088	45.379	0.000		
16	0.091	0.124	46.528	0.000		
17	-0.186	-0.048	51.377	0.000		
18	0.119	-0.018	53.395	0.000		
19	-0.134	-0.227	55.973	0.000		
20	0.034	-0.208	56.138	0.000		
21	0.063	-0.178	56.713	0.000		
22	0.060	-0.058	57.248	0.000		
23	-0.089	0.032	58.440	0.000		
24	0.027	0.005	58.547	0.000		
25	-0.047	-0.091	58.879	0.000		
26	0.066	0.012	59.558	0.000		
27	-0.024	-0.011	59.645	0.000		
28	-0.079	-0.121	60.620	0.000		
29	0.146	0.059	63.989	0.000		
30	-0.146	-0.035	67.406	0.000		
31	0.071	-0.114	68.230	0.000		
32	0.050	-0.035	68.638	0.000		
33	-0.074	-0.044	69.549	0.000		

ที่มา : จากการคำนวณ

คอเรโลแกรม ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนพฤศจิกายน
ข้อมูลรายวัน (ระดับ Level)

Date: 04/17/06 Time: 14:17
Sample: 1 123
Included observations: 123

	Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob
1	0.977	0.977	120.31	0.000		
2	0.950	-0.096	235.06	0.000		
3	0.921	-0.059	343.79	0.000		
4	0.888	-0.094	445.73	0.000		
5	0.853	-0.061	540.46	0.000		
6	0.817	-0.008	628.18	0.000		
7	0.778	-0.094	708.32	0.000		
8	0.739	0.012	781.32	0.000		
9	0.699	-0.052	847.17	0.000		
10	0.655	-0.094	905.54	0.000		
11	0.613	0.019	957.05	0.000		
12	0.570	-0.020	1002.1	0.000		
13	0.531	0.054	1041.5	0.000		
14	0.493	-0.022	1075.8	0.000		
15	0.459	0.071	1105.7	0.000		
16	0.428	0.043	1132.0	0.000		
17	0.399	-0.022	1155.1	0.000		
18	0.373	0.048	1175.4	0.000		
19	0.353	0.077	1193.9	0.000		
20	0.336	0.027	1210.7	0.000		
21	0.321	-0.012	1226.2	0.000		
22	0.305	-0.071	1240.4	0.000		
23	0.290	-0.025	1253.3	0.000		
24	0.275	-0.031	1265.1	0.000		
25	0.261	0.000	1275.8	0.000		
26	0.251	0.047	1285.8	0.000		
27	0.237	-0.100	1294.8	0.000		
28	0.223	-0.017	1302.8	0.000		
29	0.210	-0.011	1310.0	0.000		
30	0.195	-0.040	1316.3	0.000		
31	0.180	0.052	1321.7	0.000		
32	0.164	-0.077	1326.3	0.000		
33	0.141	-0.121	1329.6	0.000		

ที่มา : จากการคำนวณ

คอเรโลแกรม ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนพฤศจิกายน

ข้อมูลรายวัน (1st Difference)

Date: 04/17/06 Time: 16:27

Sample: 1 123

Included observations: 122

	Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob
1	0.104	0.104	1.3550	0.244		
2	0.104	0.095	2.7285	0.256		
3	0.170	0.153	6.3845	0.094		
4	0.107	0.073	7.8637	0.097		
5	-0.018	-0.064	7.9070	0.161		
6	0.136	0.106	10.311	0.112		
7	-0.066	-0.112	10.884	0.144		
8	0.041	0.045	11.102	0.196		
9	0.148	0.136	14.033	0.121		
10	-0.097	-0.138	15.311	0.121		
11	-0.025	-0.008	15.396	0.165		
12	-0.118	-0.186	17.324	0.138		
13	-0.038	0.029	17.523	0.176		
14	-0.244	-0.225	25.866	0.027		
15	-0.102	-0.057	27.330	0.026		
16	-0.109	0.019	29.013	0.024		
17	-0.166	-0.167	32.969	0.011		
18	-0.240	-0.141	41.373	0.001		
19	-0.171	-0.162	45.650	0.001		
20	-0.049	0.110	46.011	0.001		
21	-0.002	0.108	46.012	0.001		
22	0.037	0.087	46.224	0.002		
23	-0.065	0.041	46.866	0.002		
24	-0.001	-0.081	46.866	0.003		
25	-0.033	-0.032	47.032	0.005		
26	-0.001	-0.042	47.032	0.007		
27	-0.045	0.025	47.348	0.009		
28	0.027	0.002	47.465	0.012		
29	0.053	-0.036	47.916	0.015		
30	0.001	-0.117	47.916	0.020		
31	0.090	-0.038	49.254	0.020		
32	0.143	0.084	52.692	0.012		
33	0.093	0.035	54.161	0.012		
34	0.036	0.028	54.382	0.015		
35	0.004	0.133	54.382	0.018		

ที่มา : จากการคำนวณ

คอเรลโลแกรม ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 ของพฤศจิกายน
ข้อมูลรายวัน (2nd Difference)

Date: 04/17/06 Time: 14:20

Sample: 1 123

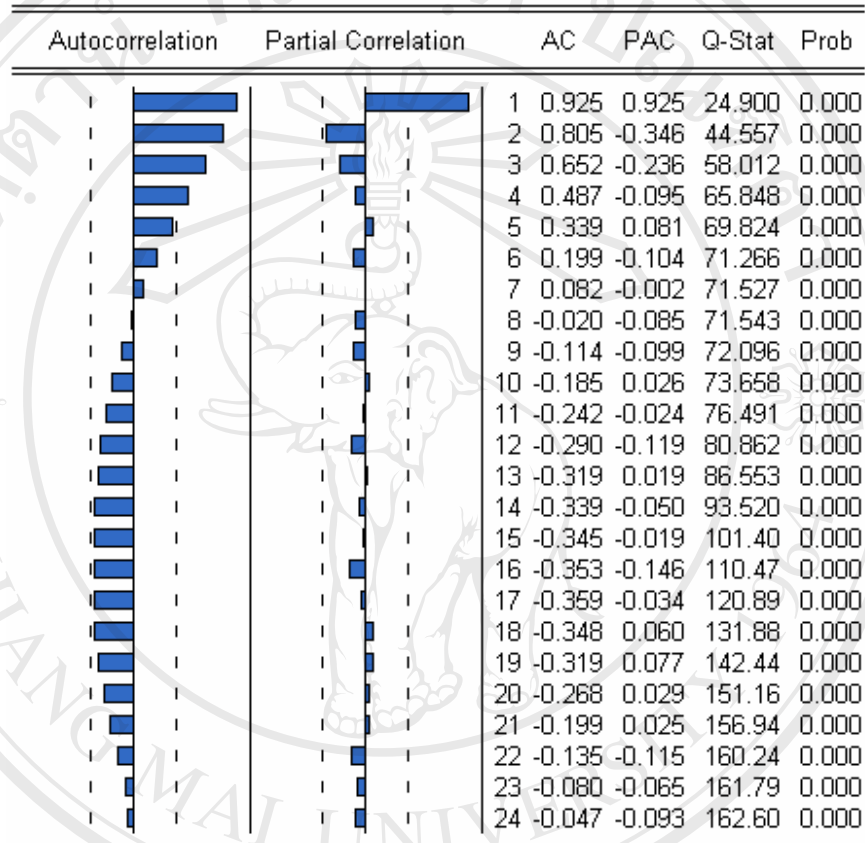
Included observations: 121

	Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob
1	-0.495	-0.495	30.425	0.000		
2	-0.037	-0.374	30.594	0.000		
3	0.072	-0.213	31.246	0.000		
4	0.031	-0.063	31.368	0.000		
5	-0.158	-0.218	34.551	0.000		
6	0.205	0.019	40.001	0.000		
7	-0.174	-0.135	43.959	0.000		
8	-0.005	-0.200	43.962	0.000		
9	0.200	0.079	49.303	0.000		
10	-0.174	-0.058	53.378	0.000		
11	0.096	0.122	54.622	0.000		
12	-0.098	-0.100	55.926	0.000		
13	0.157	0.146	59.324	0.000		
14	-0.196	-0.054	64.683	0.000		
15	0.083	-0.123	65.661	0.000		
16	0.029	0.063	65.778	0.000		
17	0.018	0.024	65.826	0.000		
18	-0.090	0.013	67.003	0.000		
19	-0.020	-0.230	67.064	0.000		
20	0.033	-0.185	67.226	0.000		
21	0.005	-0.131	67.229	0.000		
22	0.070	-0.093	67.965	0.000		
23	-0.093	0.007	69.268	0.000		
24	0.070	-0.009	70.016	0.000		
25	-0.044	-0.003	70.314	0.000		
26	0.054	-0.028	70.768	0.000		
27	-0.075	-0.015	71.663	0.000		
28	0.025	0.015	71.765	0.000		
29	0.045	0.097	72.087	0.000		
30	-0.080	-0.011	73.146	0.000		
31	-0.002	-0.118	73.147	0.000		
32	0.081	-0.058	74.239	0.000		
33	0.018	-0.005	74.296	0.000		

ที่มา : จากการคำนวณ

คอเรโลแกรม ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนกันยายน
ข้อมูลรายสัปดาห์ (ระดับ Level)

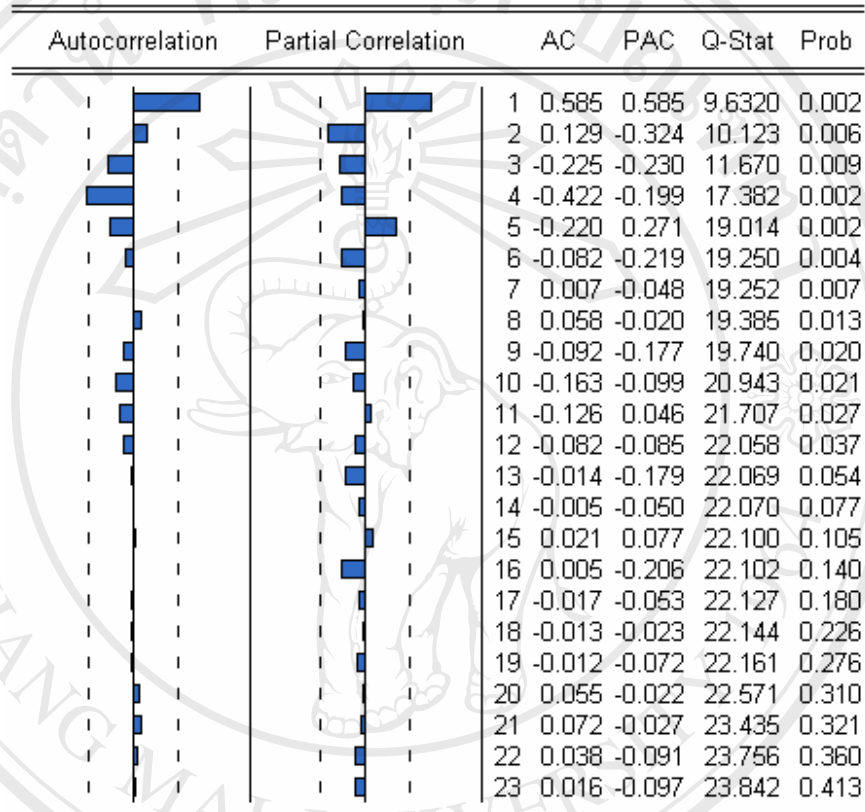
Date: 04/17/06 Time: 14:50
Sample: 1 29
Included observations: 26



ที่มา : จากการคำนวณ

คอเรโลแกรมราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนกันยายน
ข้อมูลรายสัปดาห์ (1st Difference)

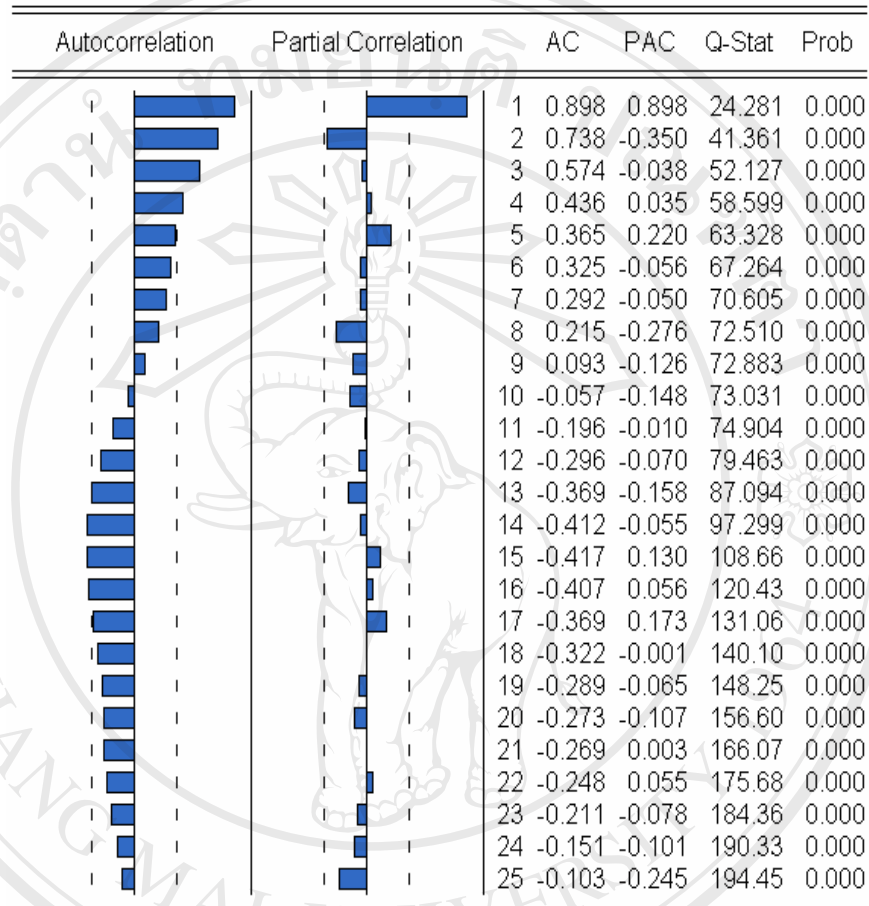
Date: 04/17/06 Time: 14:51
Sample: 1 29
Included observations: 25



ที่มา : จากการคำนวณ

คอเรโลแกรม ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนตุลาคม

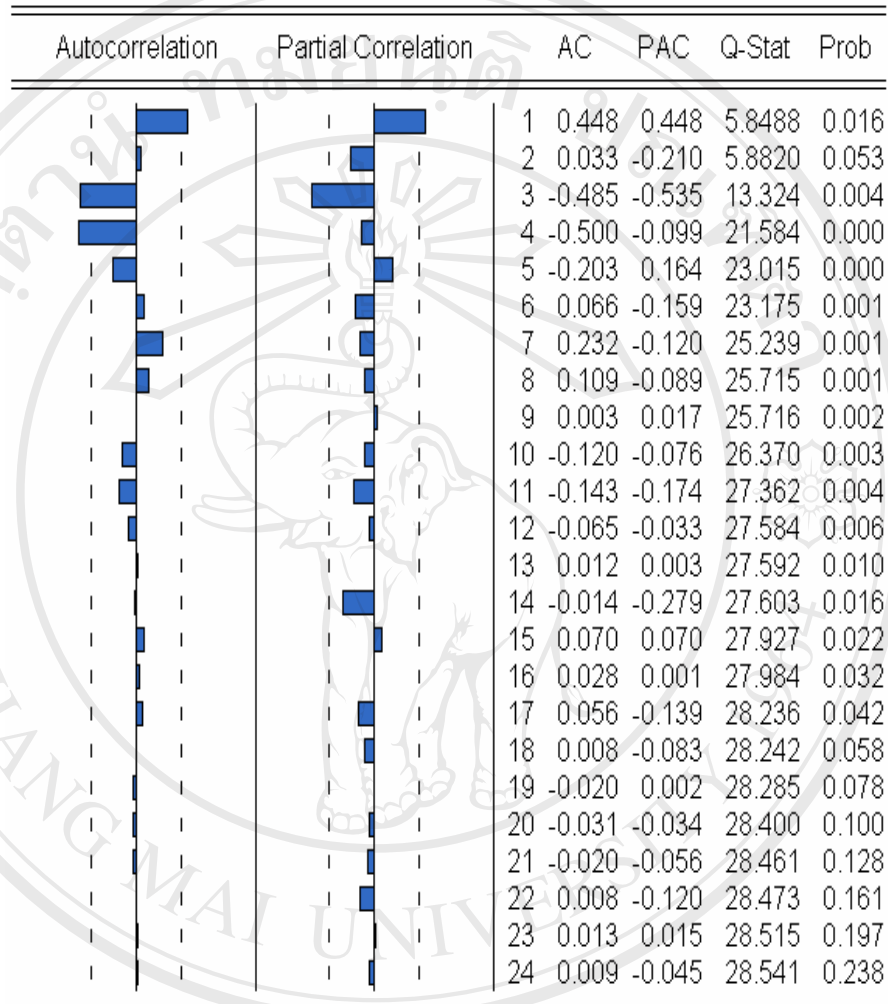
ข้อมูลรายสัปดาห์ (ระดับ Level)



ที่มา : จากการคำนวณ

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

คอเรโลแกรม ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนตุลาคม
ข้อมูลรายสัปดาห์ (1st Difference)



ที่มา : จากการคำนวณ

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

คอเรลโลแกรม ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนพฤศจิกายน
ข้อมูลรายสัปดาห์ (ระดับ Level)

Date: 05/09/06 Time: 16:16
Sample: 1 27
Included observations: 27

	Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob
1	0.883	0.883	23.483	0.000		
2	0.715	-0.295	39.483	0.000		
3	0.534	-0.113	48.785	0.000		
4	0.405	0.157	54.382	0.000		
5	0.330	0.073	58.256	0.000		
6	0.253	-0.191	60.643	0.000		
7	0.180	-0.008	61.907	0.000		
8	0.064	-0.215	62.074	0.000		
9	-0.031	0.083	62.117	0.000		
10	-0.092	0.053	62.503	0.000		
11	-0.113	-0.014	63.123	0.000		
12	-0.122	-0.105	63.899	0.000		
13	-0.129	0.064	64.837	0.000		
14	-0.164	-0.170	66.452	0.000		
15	-0.222	-0.085	69.666	0.000		
16	-0.302	-0.189	76.138	0.000		
17	-0.366	-0.010	86.639	0.000		
18	-0.391	0.020	99.917	0.000		
19	-0.387	0.003	114.59	0.000		
20	-0.347	0.034	128.04	0.000		
21	-0.325	-0.096	141.78	0.000		
22	-0.281	0.147	154.17	0.000		
23	-0.242	-0.023	165.65	0.000		
24	-0.183	0.018	174.41	0.000		
25	-0.114	-0.049	179.53	0.000		

ที่มา : จากการคำนวณ

คอเรโลแกรม ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนพฤศจิกายน
ข้อมูลรายสัปดาห์ (1st Difference)

Date: 05/09/06 Time: 16:17
Sample: 1 27
Included observations: 26

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
		1	0.346	0.346	3.4788	0.062
		2	-0.012	-0.149	3.4831	0.175
		3	-0.514	-0.531	11.839	0.008
		4	-0.414	-0.107	17.504	0.002
		5	-0.079	0.156	17.719	0.003
		6	0.095	-0.234	18.050	0.006
		7	0.184	-0.126	19.351	0.007
		8	-0.027	-0.110	19.381	0.013
		9	-0.084	-0.078	19.680	0.020
		10	-0.016	0.080	19.692	0.032
		11	0.090	-0.004	20.086	0.044
		12	0.094	-0.153	20.549	0.057
		13	0.053	0.099	20.706	0.079
		14	-0.076	-0.001	21.053	0.100
		15	-0.038	0.021	21.149	0.132
		16	-0.109	-0.124	22.013	0.143
		17	-0.020	-0.042	22.046	0.183
		18	0.004	0.064	22.047	0.230
		19	0.014	-0.051	22.068	0.281
		20	-0.015	-0.187	22.094	0.335
		21	-0.001	0.054	22.094	0.394
		22	-0.005	-0.046	22.098	0.454
		23	0.009	-0.094	22.118	0.513
		24	0.012	-0.018	22.174	0.569

ที่มา : จากการคำนวณ

ภาคผนวก จ

แสดงคอเรลโลแกรมแบบจำลอง ARIMA ที่เหมาะสม

คอเรลโลแกรมราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนกันยายน ข้อมูลรายวัน

รูปแบบอาร์มา AR(1) AR(2) AR(17) MA(3) MA(7) MA(18)

Sample: 20 122

Included observations: 103

Q-statistic probabilities adjusted for 6 ARMA term(s)

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
		1	0.037	0.037	0.1482	
		2	-0.167	-0.169	3.1299	
		3	-0.140	-0.131	5.2631	
		4	-0.064	-0.087	5.7048	
		5	0.007	-0.037	5.7104	
		6	0.102	0.061	6.8638	
		7	0.010	-0.018	6.8755	0.009
		8	0.078	0.103	7.5682	0.023
		9	0.029	0.049	7.6666	0.053
		10	0.052	0.101	7.9826	0.092
		11	-0.140	-0.110	10.298	0.067
		12	-0.024	0.021	10.368	0.110
		13	-0.005	-0.028	10.371	0.169
		14	-0.169	-0.229	13.830	0.086
		15	0.084	0.069	14.702	0.099
		16	0.088	-0.018	15.662	0.110
		17	0.003	-0.004	15.663	0.154
		18	-0.164	-0.189	19.094	0.086
		19	-0.227	-0.211	25.740	0.018
		20	-0.040	-0.059	25.948	0.026
		21	0.183	0.084	30.344	0.011
		22	0.000	-0.088	30.344	0.016
		23	0.012	0.018	30.362	0.024
		24	-0.009	0.069	30.375	0.034
		25	-0.065	-0.096	30.969	0.041
		26	-0.124	-0.087	33.131	0.033
		27	-0.016	-0.012	33.170	0.044
		28	0.020	-0.019	33.228	0.059
		29	-0.017	-0.092	33.271	0.076
		30	0.053	-0.028	33.682	0.090
		31	-0.005	-0.081	33.686	0.115
		32	0.028	0.013	33.807	0.140
		33	0.093	0.014	35.146	0.135

ที่มา : จากการคำนวณ

คอเรโลแกรมราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนตุลาคม ข้อมูลรายวัน

รูปแบบอาร์มา AR(1)AR(2)AR(17)MA(3)MA(7)MA(11)MA(14) MA(18)

Date: 04/17/06 Time: 14:27

Sample: 20 120

Included observations: 101

Q-statistic probabilities adjusted for 8 ARMA term(s)

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
		1	0.038	0.038	0.1529	
		2	-0.122	-0.124	1.7197	
		3	-0.157	-0.150	4.3402	
		4	-0.183	-0.195	7.9194	
		5	-0.027	-0.065	7.9958	
		6	0.089	0.017	8.8614	
		7	0.022	-0.051	8.9135	
		8	-0.124	-0.173	10.637	
		9	0.161	0.169	13.572	0.000
		10	-0.131	-0.180	15.539	0.000
		11	-0.149	-0.171	18.121	0.000
		12	0.041	-0.003	18.313	0.001
		13	0.062	0.027	18.767	0.002
		14	-0.071	-0.187	19.365	0.004
		15	-0.011	-0.106	19.380	0.007
		16	0.034	0.013	19.521	0.012
		17	-0.107	-0.120	20.948	0.013
		18	0.042	-0.144	21.166	0.020
		19	-0.080	-0.180	21.969	0.025
		20	0.087	0.106	22.935	0.028
		21	0.135	-0.009	25.305	0.021
		22	0.124	-0.020	27.323	0.017
		23	-0.031	0.023	27.450	0.025
		24	-0.103	-0.014	28.872	0.025
		25	0.034	0.004	29.028	0.034
		26	-0.010	0.009	29.041	0.048
		27	-0.046	-0.107	29.335	0.061
		28	-0.130	-0.162	31.739	0.046
		29	-0.059	-0.167	32.240	0.055
		30	-0.045	-0.171	32.537	0.069
		31	0.128	-0.004	34.975	0.052
		32	0.095	-0.036	36.342	0.051
		33	0.043	-0.008	36.630	0.063

ที่มา : จากการคำนวณ

คอเรโลแกรม ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนพฤศจิกายน ข้อมูลรายวัน

รูปแบบอาร์มา AR(1) AR(2) MA(3) MA(7) MA(12)

Date: 04/17/06 Time: 14:30

Sample: 5 123

Included observations: 119

Q-statistic probabilities adjusted for 5 ARMA term(s)

	Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob
1	-0.051	-0.051	0.3208			
2	0.086	0.083	1.2211			
3	-0.111	-0.103	2.7426			
4	-0.055	-0.072	3.1154			
5	-0.088	-0.078	4.0986			
6	-0.073	-0.084	4.7752	0.029		
7	-0.049	-0.060	5.0861	0.079		
8	0.101	0.088	6.4157	0.093		
9	0.034	0.026	6.5643	0.161		
10	-0.022	-0.064	6.6277	0.250		
11	0.062	0.057	7.1417	0.308		
12	-0.061	-0.047	7.6434	0.365		
13	0.055	0.043	8.0578	0.428		
14	-0.161	-0.130	11.612	0.236		
15	0.026	0.010	11.708	0.305		
16	-0.075	-0.058	12.495	0.328		
17	-0.101	-0.154	13.944	0.304		
18	-0.193	-0.220	19.238	0.116		
19	-0.138	-0.222	21.965	0.079		
20	0.050	-0.014	22.354	0.099		
21	0.102	0.030	23.869	0.092		
22	0.115	0.056	25.833	0.078		
23	-0.016	-0.089	25.872	0.103		
24	0.054	-0.034	26.319	0.122		
25	-0.076	-0.056	27.196	0.130		
26	0.000	0.002	27.196	0.164		
27	-0.050	0.035	27.592	0.190		
28	-0.035	-0.084	27.785	0.224		
29	0.020	-0.022	27.847	0.267		
30	-0.040	-0.127	28.102	0.303		
31	0.050	-0.045	28.509	0.334		
32	0.136	0.079	31.581	0.248		
33	0.107	0.060	33.495	0.218		
34	0.088	0.037	33.637	0.255		

ที่มา : จากการคำนวณ

คอเรโลแกรม ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนกันยายน ข้อมูลรายสัปดาห์
รูปแบบอาร์มา AR(1) AR(3) MA(3) SMA(7)

Date: 04/17/06 Time: 11:37

Sample: 5 26

Included observations: 22

Q-statistic probabilities adjusted for 4 ARMA term(s)

	Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob
1	-0.138	-0.138	0.4774			
2	-0.130	-0.152	0.9212			
3	0.170	0.134	1.7262			
4	-0.169	-0.153	2.5687			
5	-0.062	-0.069	2.6885	0.101		
6	0.062	-0.019	2.8162	0.245		
7	-0.140	-0.118	3.5103	0.319		
8	-0.007	-0.047	3.5121	0.476		
9	-0.051	-0.131	3.6161	0.606		
10	0.107	0.120	4.1228	0.660		
11	-0.109	-0.158	4.6943	0.697		
12	0.041	0.045	4.7815	0.781		
13	0.070	-0.020	5.0657	0.829		
14	-0.197	-0.166	7.6345	0.664		
15	0.009	-0.065	7.6412	0.745		
16	0.107	-0.001	8.6493	0.733		
17	-0.044	0.058	8.8583	0.784		
18	-0.060	-0.167	9.3256	0.810		
19	-0.020	-0.072	9.3946	0.856		
20	0.048	-0.002	10.005	0.866		

ที่มา : จากการคำนวณ

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

คอเรโลแกรม ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนตุลาคม ข้อมูลรายสัปดาห์

รูปแบบอาร์มา AR(1) AR(3) MA(8)

Date: 04/17/06 Time: 14:37

Sample: 5 27

Included observations: 23

Q-statistic probabilities adjusted for 3 ARMA term(s)

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob
		1 -0.262	-0.262	1.7991	
		2 0.241	0.185	3.3870	
		3 -0.069	0.034	3.5253	
		4 -0.090	-0.159	3.7723	0.052
		5 0.032	-0.015	3.8057	0.149
		6 -0.170	-0.123	4.7873	0.188
		7 -0.120	-0.227	5.3053	0.257
		8 -0.181	-0.253	6.5626	0.255
		9 -0.051	-0.121	6.6689	0.353
		10 0.095	0.097	7.0675	0.422
		11 -0.162	-0.193	8.3263	0.402
		12 0.190	-0.025	10.223	0.333
		13 -0.006	0.061	10.226	0.421
		14 0.014	-0.146	10.239	0.509
		15 0.137	-0.063	11.584	0.480
		16 -0.188	-0.216	14.473	0.341
		17 0.127	-0.064	16.027	0.312
		18 -0.071	-0.025	16.599	0.343
		19 0.057	-0.031	17.065	0.381
		20 -0.066	-0.103	17.889	0.396
		21 0.057	0.064	18.821	0.403

ที่มา : จากการคำนวณ

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

คอเรลโลแกรม ราคาสัญญาล่วงหน้าของยางพาราแผ่นรมควัน ชั้น 3 เดือนพฤศจิกายน

ข้อมูลรายสัปดาห์ รูปแบบอาร์มา AR(3) MA(4)

Date: 05/10/06 Time: 10:53

Sample: 5 27

Included observations: 23

Q-statistic probabilities adjusted for 2 ARMA term(s)

	Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob
1	0.094	0.094	0.2301			
2	0.033	0.024	0.2600			
3	-0.082	-0.088	0.4538	0.501		
4	0.063	0.080	0.5750	0.750		
5	-0.232	-0.246	2.2977	0.513		
6	-0.169	-0.140	3.2595	0.515		
7	0.023	0.087	3.2788	0.657		
8	-0.122	-0.193	3.8478	0.697		
9	-0.085	-0.055	4.1459	0.763		
10	0.051	0.069	4.2600	0.833		
11	0.250	0.143	7.2663	0.609		
12	-0.143	-0.204	8.3289	0.597		
13	-0.088	-0.107	8.7783	0.642		
14	-0.149	-0.191	10.198	0.599		
15	0.014	-0.015	10.212	0.677		
16	-0.195	-0.116	13.321	0.501		
17	-0.021	-0.078	13.364	0.574		
18	0.104	0.051	14.616	0.553		
19	0.037	-0.039	14.818	0.609		
20	-0.036	-0.124	15.066	0.657		
21	0.090	-0.014	17.384	0.564		

ที่มา : จากการคำนวณ

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

ประวัติผู้เขียน

ชื่อ	นางสาวพัชฌิตา ณ ลำพูน
วัน เดือน ปี เกิด	9 พฤษภาคม 2523
ประวัติการศึกษา	สำเร็จการศึกษามัธยมศึกษาตอนปลาย โรงเรียนปรินสรอยเฮลล์ วิทยาลัยเชียงใหม่ ปีการศึกษา 2540 สำเร็จการศึกษาปริญญาบัญชีบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ ปีการศึกษา 2544
ประสบการณ์	เจ้าหน้าที่ตรวจสอบภายใน สำนักงานตรวจสอบภายใน มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ ตั้งแต่ ตุลาคม 2547 - ปัจจุบัน

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved