

หัวข้อโครงงานวิจัย	เว็บไซต์วิเคราะห์ความเป็นไปได้ของค่าเงินฟอเร็กซ์		
นักศึกษา	นางสาวจุฑาภรณ์	ลายเงิน	รหัส 115810905113-1
	นายอาทิตย์	เชื้อหอม	รหัส 115810905122-2
อาจารย์ที่ปรึกษา	ดร.พิเชฐ	คุณากรวงศ์	
ปีการศึกษา	2561		

บทคัดย่อ

งานวิจัยนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อพัฒนาแบบจำลองการพยากรณ์การเปลี่ยนแปลงของค่าเงินดอลลาร์เพื่อวางแผนในภาคธุรกิจและพัฒนาเศรษฐกิจของประเทศ โดยใช้วิธีการวิเคราะห์อนุกรมเวลาด้วยเทคนิคเหมือนข้อมูล 3 เทคนิคได้แก่เพื่อนบ้านใกล้เคียง ต้นไม้ตัดสินใจและโครงข่ายประสาทเทียม ข้อมูลที่นำมาใช้ในการศึกษาเป็นข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยนสกุลเงินต่างประเทศ 4 สกุลเงินคือ ดอลลาร์สหรัฐ บาท ฟรังก์สวิสและเยนประจำปี พ.ศ. 2553 – 2561 จำนวน 108 เดือน จากผลการวิจัยพบว่าแบบจำลองที่มีความเหมาะสมและมีความแม่นยำในการพยากรณ์อัตราแลกเปลี่ยนสำหรับข้อมูลตัวอย่างคือการวิเคราะห์ด้วยเทคนิคเพื่อนบ้าน โดยมีค่าเฉลี่ยความคลาดเคลื่อนสัมพัทธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐเทียบกับสกุลเงินไทย 0.55 เปอร์เซ็นต์ ค่าเฉลี่ยความคลาดเคลื่อนสัมพัทธ์อัตราแลกเปลี่ยนสกุลเงินสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐเทียบกับสกุลเงินฟรังก์สวิสมีค่า 0.54 เปอร์เซ็นต์และอัตราแลกเปลี่ยนสกุลเงินสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐเทียบกับสกุลเงินญี่ปุ่นมีค่าเฉลี่ยความคลาดเคลื่อนสัมพัทธ์มีค่า 0.72 เปอร์เซ็นต์

คำสำคัญ การพยากรณ์ อัตราแลกเปลี่ยนสกุลเงินต่างประเทศ ค่าเฉลี่ยความคลาดเคลื่อนสัมพัทธ์