

กระบวนการจัดทำและเผยแพร่ดัชนีเศรษฐกิจการค้า
(ดัชนีวัฏจักรธุรกิจและดัชนีวัฏจักรเงินเฟ้อ)

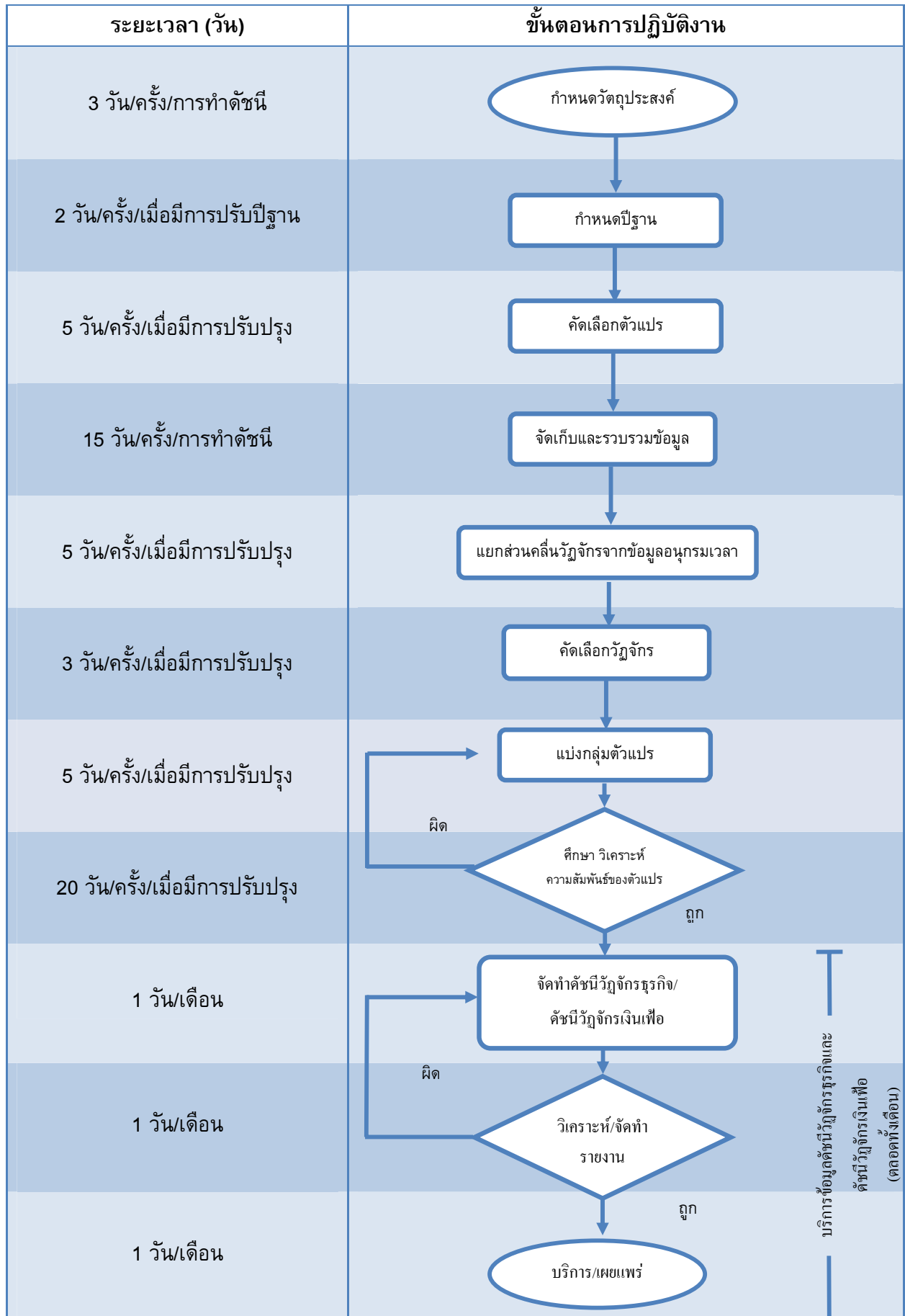
สำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า

กระบวนการจัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจและดัชนีวัฏจักรเงินเฟ้อ

ข้อกำหนด

1. ความต้องการของผู้รับบริการและผู้มีส่วนได้ส่วนเสีย
 - 1.1 ดัชนีวัฏจักรธุรกิจและดัชนีวัฏจักรเงินเฟ้อเพื่อความถูกต้องแม่นยำ
 - 1.2 ดัชนีวัฏจักรธุรกิจและดัชนีวัฏจักรเงินเฟ้อเผยแพร่ได้ตรงตามกำหนดไว้ คือ วันทำการแรกของเดือน
 - 1.3 ลูกค้านำสามารถเข้าถึงข้อมูลได้สะดวก
2. กฎหมาย กฎ ระเบียบ
 - 2.1 พระราชกฤษฎีกาการจัตระเบียบราชการให้กรมสารสนเทศในกระทรวงเศรษฐกิจ พ.ศ. 2485 มีหน้าที่เกี่ยวกับการรวบรวมสถิติด้านระดับราคาและค่าครองชีพ
 - 2.2 พระราชกิจจานุเบกษา กฎกระทรวง แบ่งส่วนราชการสำนักงานปลัดกระทรวงพาณิชย์ พ.ศ. 2553 เล่มที่ 127 ตอนที่ 22 ก หน้า 8 ข้อ 12
3. ประสิทธิภาพของกระบวนการ
 - 3.1 จัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจและดัชนีวัฏจักรเงินเฟ้อ ตามระเบียบวิธีทางสถิติ
 - 3.2 จัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจและดัชนีวัฏจักรเงินเฟ้อ ตามมาตรฐานสากล

แผนผังขั้นตอนกระบวนการจัดทำดัชนีวิจัยธุรกิจและดัชนีวิจัยการเงินเพื่อ





ระเบียบปฏิบัติงาน

เลขที่เอกสาร สด.07.01

หน่วยงาน : สำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า (กลุ่มดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจ)

แก้ไขครั้งที่ 03

เรื่อง : การจัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจและวัฏจักรเงินเฟ้อ

หน้าที่ 1/14

1. วัตถุประสงค์
2. ขอบเขต
3. คำจำกัดความ
4. ความรับผิดชอบ
5. ขั้นตอนการปฏิบัติงาน
6. มาตรฐานการปฏิบัติงาน
7. เอกสารอ้างอิง
8. แบบฟอร์มที่ใช้
9. เอกสารบันทึก

จัดทำโดย	ตรวจสอบโดย	อนุมัติโดย
<p>..... นางสาวณิชาภัทร กาญจนอุดมการ (นางสาวณิชาภัทร กาญจนอุดมการ) นักวิชาการพาณิชย์ชำนาญการ</p>	<p>..... (นางสาวสมจิตร เดิมธรณินทร์) นักวิชาการพาณิชย์ชำนาญการพิเศษ</p>	<p>..... (นางวิภาดา ศรีสัตย์) ผู้อำนวยการสำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า</p>

ประวัติการแก้ไข

วันที่บังคับใช้	แก้ไขครั้งที่	ข้อความ
25 พฤษภาคม 2552	00	เอกสารออกใหม่
26 มกราคม 2553	01	แก้ไขรายละเอียด
28 มิถุนายน 2553	02	จัดลำดับหัวข้อใหม่
12 กรกฎาคม 2553	03	แก้ไข ปก เลขหน้า และ Flowchart

	ระเบียบปฏิบัติงาน	เลขที่เอกสาร ศค.07.01
	หน่วยงาน : สำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า (กลุ่มดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจ)	แก้ไขครั้งที่ 03
	เรื่อง : การจัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจและวัฏจักรเงินเฟ้อ	หน้าที่ 2/14

1. วัตถุประสงค์

ระเบียบปฏิบัติงานฉบับนี้จัดทำขึ้นเพื่อเป็นมาตรฐานในการจัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจและวัฏจักรเงินเฟ้อ

2. ขอบเขต

ระเบียบปฏิบัติงานฉบับนี้รายละเอียดครอบคลุมการจัดทำดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจของประเทศทุกขั้นตอน ตั้งแต่ขั้นตอนแรกคือ การจัดเก็บข้อมูลจนถึงขั้นตอนสุดท้าย คือ การเผยแพร่ดัชนี

3. คำจำกัดความ


3.1 วัฏจักรธุรกิจ (Business Cycle) คือ การหมุนเวียนเปลี่ยนแปลงขึ้นๆ ลงๆ ของภาวะเศรษฐกิจ ซึ่งจะแบ่งออกได้เป็น 4 ช่วง คือ

3.1.1 ช่วงขยายตัว (Expansion) เป็นภาวะเศรษฐกิจที่เกิดขึ้นหลังจากเศรษฐกิจตกต่ำถึงขีดสุด ในระยะนี้เศรษฐกิจโดยทั่วไปเริ่มจะดีขึ้น สินค้าที่เหลือค้างสต็อกเริ่มค่อยๆ ทอยขายออก ราคาสินค้าเริ่มมีแนวโน้มสูงขึ้น การคาดคะเนกำไรของผู้ผลิตหรือผู้ประกอบการเป็นไปในแนวทางที่ดีขึ้น ผู้ผลิตจะหันมาลงทุนในกิจการมากขึ้น ผลผลิตผลิตเพิ่มขึ้น การจ้างงานก็จะสูงขึ้น กอปรกับประชาชนเริ่มมีรายได้ดีขึ้น ภาวะเศรษฐกิจจะเริ่มฟื้นตัวขึ้นอย่างรวดเร็ว ธนาคารรวมทั้งสถาบันการเงินอื่นๆ จะเริ่มปล่อยสินเชื่อในอัตราดอกเบี้ยต่ำลงเพื่อกระตุ้นให้ผู้ผลิตและผู้ประกอบการลงทุนเพิ่มขึ้น

3.1.2 ช่วงเจริญรุ่งเรืองสูงสุด (Peak) เป็นระยะที่เศรษฐกิจเฟื่องฟู มีบรรยากาศแห่งการลงทุนที่ดี ผู้ผลิตหรือผู้ประกอบการคาดคะเนกำไรไปในทางที่ดีมากคือมีความมั่นใจ ในอัตราผลตอบแทนที่จะได้รับการลงทุนต่างๆ จะขยายตัวอย่างรวดเร็ว การจ้างงานจะเพิ่มขึ้นมาก ประชาชนมีรายได้สูงขึ้นมาก และสามารถจับจ่ายใช้สอยสินค้าและบริการได้มากขึ้น เป็นระยะที่มีการซื้อขายคล่อง เศรษฐกิจจะมีการเจริญเติบโตในอัตราสูง ราคาของสินค้าและบริการมีแนวโน้มปรับตัวสูงขึ้นจนอาจจะก่อให้เกิดแรงกดดันเงินเฟ้อขึ้นมาได้

3.1.3 ช่วงหดตัว (Contraction) เป็นระยะที่ต่อเนื่องกับระยะเศรษฐกิจรุ่งเรือง เมื่อภาวะเศรษฐกิจเจริญรุ่งเรืองอย่างเต็มที่แล้วผลที่จะตามมาอย่างหลีกเลี่ยงไม่ได้ก็คือแรงกดดันที่จะก่อให้เกิดภาวะเงินเฟ้อขึ้น เนื่องจากการที่มีการผลิต การลงทุน และการบริโภครวมเกินกว่ากำลังการผลิตของประเทศ รวมทั้งการที่ต้นทุนการผลิตโดยรวมสูงขึ้นเพราะจะต้องแข่งขันกันในการแย่งทรัพยากรการผลิตมาใช้ผลิตสินค้าและบริการในกิจการของตน สภาพการแข่งขันกันผลิตทำให้ราคาและผลตอบแทนลดต่ำลง ผู้ผลิตเกิดความไม่มั่นใจในอนาคตทำให้ลดการลงทุน ส่งผลให้การผลิตและการจ้างงานลดลง รายได้ของประชาชนน้อยลง สภาพเศรษฐกิจโดยทั่วไปเริ่มมีแนวโน้มที่เลวลง

3.1.4 ช่วงต่ำสุด (Depression) เป็นระยะที่ต่อเนื่องจากระยะเศรษฐกิจถดถอย การลงทุนรวมจะลดลงมาก ประกอบกับอัตราดอกเบี้ยจะสูงขึ้น ธนาคารและสถาบันการเงินจะเร่งรัดให้ผู้ผลิตและ

	ระเบียบปฏิบัติงาน	เลขที่เอกสาร ศค.07.01
	หน่วยงาน : สำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า (กลุ่มดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจ)	แก้ไขครั้งที่ 03
	เรื่อง : การจัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจและวัฏจักรเงินเฟ้อ	หน้าที่ 3/14

ผู้ประกอบการชำระเงินต้นและจ่ายคืนดอกเบี้ย และมีแนวโน้มที่จะปฏิเสธการขยายวงเงินสินเชื่อออกไป ผู้ผลิตและผู้ประกอบการจะไม่มี ความมั่นใจในกำไรและอัตราผลตอบแทนที่จะได้รับ ไม่คุ้มกับความเสี่ยงที่จะตัดสินใจลงทุน ทำให้การลงทุนชะงักงัน ในที่สุดเศรษฐกิจจะเกิดการหดตัวลงถึงจุดต่ำสุด ภาวะการซื้อ ง่ายขายคล่องจะหายไป สินค้าเดิมที่ผลิตออกมาแล้วก็ขายไม่หมด มีสินค้าค้างสต็อกจำนวนมาก มีการลดการผลิต การจ้างงาน เกิดภาวะการว่างงานกระจายตัวโดยทั่วไป ประชาชนไม่ค่อยมีกำลังซื้อเพราะมีรายได้ลดลงมาก

3.2 ดัชนีวัฏจักรธุรกิจ (Business Cycle Index) คือ ดัชนีที่จัดทำจากคลื่นวัฏจักร (Cycle component) ของตัวแปรที่สำคัญๆทางเศรษฐกิจและการเงินต่างๆ เพื่อใช้ในการคาดการณ์ ติดตามและประเมินความ เป็นไปของภาวะเศรษฐกิจโดยรวม

3.3 จุดวกกลับ (Turning Point) คือ จุดเปลี่ยนแปลงของคลื่นวัฏจักร ซึ่งแบ่งออกเป็น 2 ชนิด คือ

3.3.1 จุดสูงสุด (Peak) คือ จุดที่ภาวะเศรษฐกิจมีการขยายตัวมากที่สุด เป็นจุดสิ้นสุดของ ภาวะการขยายตัว และเตรียมตัวเข้าสู่ภาวะชะลอตัว (ถดถอย) ทางเศรษฐกิจ

3.3.2 จุดต่ำสุด (Trough) คือ จุดที่ภาวะเศรษฐกิจมีการหดตัวมากที่สุด เป็นจุดสิ้นสุดของภาวะ ชะลอตัว (ถดถอย) ทางเศรษฐกิจ และเตรียมตัวเข้าสู่ภาวะฟื้นตัวทางเศรษฐกิจ

3.4 วัฏจักร (Duration of Cycle) คือ ช่วงของคลื่นเศรษฐกิจจากจุดสูงสุดหนึ่งถึงจุดสูงสุดถัดไป หรือ จากจุดต่ำสุดหนึ่งถึงจุดต่ำสุดถัดไป

3.5 ช่วง (Phase) คือ ช่วงของคลื่นเศรษฐกิจจุดสูงสุดหนึ่งถึงจุดต่ำสุดถัดไป หรือจากจุดต่ำสุดหนึ่งถึง จุดสูงสุดถัดไป

3.6 อัตราการขยายตัว(six-month smoothed annualized growth rate)

3.6.1 เศรษฐกิจเป็นช่วงขยายตัว เมื่อ ค่าอัตราการขยายตัวเป็นบวก


3.6.2 เศรษฐกิจเป็นช่วงหดตัว เมื่อ ค่าอัตราการขยายตัวเป็นลบมากกว่าร้อยละ 5 ติดต่อกัน มากกว่า 3 เดือน

3.7 ดัชนีพ้องวัฏจักรธุรกิจ (Coincident Business Cycle Index) เป็นดัชนีที่แสดงทิศทางเศรษฐกิจ ปัจจุบัน โดยมีคลื่นวัฏจักรสอดคล้องกับระยะเวลาการเปลี่ยนแปลงของภาวะเศรษฐกิจที่เกิดขึ้นจริง

3.8 ดัชนีชี้นำวัฏจักรธุรกิจระยะสั้น (Short-run Leading Business Cycle Index) เป็นดัชนีที่มีทิศ ทิศทางเปลี่ยนแปลงก่อนที่ภาวะเศรษฐกิจจริงจะเกิดขึ้น ใช้คาดการณ์ทิศทางของเศรษฐกิจล่วงหน้า 3-5 เดือน

3.9 ดัชนีชี้นำวัฏจักรธุรกิจระยะกลาง (Medium-run Leading Business Cycle Index) เป็นดัชนีที่มีทิศ ทิศทางเปลี่ยนแปลงก่อนที่ภาวะเศรษฐกิจจริงจะเกิดขึ้น ใช้คาดการณ์ทิศทางของเศรษฐกิจล่วงหน้า 9-11 เดือน

3.10 ดัชนีอ้างอิงวัฏจักรเงินเฟ้อ (Reference Inflation Index) เป็นดัชนีที่คำนวณจากอัตราการขยายตัว ของดัชนีราคาผู้บริโภค

	ระเบียบปฏิบัติงาน	เลขที่เอกสาร สด.07.01
	หน่วยงาน : สำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า (กลุ่มดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจ)	แก้ไขครั้งที่ 03
	เรื่อง : การจัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจและวัฏจักรเงินเฟ้อ	หน้าที่ 4/14

3.11 ดัชนีชี้นำวัฏจักรเงินเฟ้อ (Leading Inflation Index) เป็นดัชนีที่มีทิศทางเปลี่ยนแปลงก่อนวัฏจักรเงินเฟ้อใช้คาดการณ์ทิศทางของภาวะเงินเฟ้อล่วงหน้า 7-9 เดือน

4. ความรับผิดชอบ

- 4.1 ผู้อำนวยการสำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า
- 4.2 หัวหน้ากลุ่ม
- 4.3 นักวิชาการพาณิชย์



5. ขั้นตอนการปฏิบัติงาน

ลำดับที่	ระยะเวลา	ผังกระบวนการ	รายละเอียดงาน	ผู้รับผิดชอบ	เอกสารอ้างอิง
1	3 วัน/ครั้ง/การนำดัชนี	กำหนดวัตถุประสงค์	ศึกษาประโยชน์ที่ได้รับจากการจัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจและวัฏจักรเงินเฟ้อ	นักวิชาการพาณิชย์	1. รายงานโครงการศึกษาและจัดทำดัชนีชี้นำวัฏจักรธุรกิจระยะกลางและดัชนีวัฏจักรเงินเฟ้อสำหรับประเทศไทย
2	2 วัน/ครั้ง/เมื่อมีการปรับปรุง	กำหนดปีฐาน	พิจารณาปีที่มีเสถียรภาพ ระบบราคาเป็นไปตามภาวะอุปสงค์และอุปทานของระบบเศรษฐกิจ	นักวิชาการพาณิชย์	1. รายงานโครงการศึกษาและจัดทำดัชนีชี้นำวัฏจักรธุรกิจระยะกลางและดัชนีวัฏจักรเงินเฟ้อสำหรับประเทศไทย
3	5 วัน/ครั้ง/เมื่อมีการปรับปรุง	คัดเลือกตัวแปร	คัดเลือกตัวแปรให้ถูกต้องตามหลักเกณฑ์ทางสถิติและเศรษฐศาสตร์	นักวิชาการพาณิชย์	1. รายงานโครงการศึกษาและจัดทำดัชนีชี้นำวัฏจักรธุรกิจระยะกลางและดัชนีวัฏจักรเงินเฟ้อสำหรับประเทศไทย
4	15 วัน/ครั้ง/เมื่อมีการปรับปรุง	จัดเก็บและรวบรวมข้อมูล	จัดเก็บ และรวบรวม ข้อมูลสถิติทางด้านเศรษฐกิจ ที่หน่วยงานต่างๆ จัดทำ และเผยแพร่เป็นรายเดือน และรายไตรมาส บันทึกลงฐานข้อมูล	นักวิชาการพาณิชย์	1. รายงานโครงการศึกษาและจัดทำดัชนีชี้นำวัฏจักรธุรกิจระยะกลางและดัชนีวัฏจักรเงินเฟ้อสำหรับประเทศไทย
5	5 วัน/ครั้ง/เมื่อมีการปรับปรุง	แยกคลื่นวัฏจักรจากข้อมูลอนุกรมเวลา	ทำการวิเคราะห์อนุกรมเวลา (Time Series Analysis) โดยการแยกคลื่นวัฏจักรออกจากข้อมูลอนุกรมเวลา	นักวิชาการพาณิชย์	1. รายงานโครงการศึกษาและจัดทำดัชนีชี้นำวัฏจักรธุรกิจระยะกลางและดัชนีวัฏจักรเงินเฟ้อสำหรับประเทศไทย
6	3 วัน/ครั้ง/เมื่อมีการปรับปรุง	คัดเลือกวัฏจักร	เมื่อแยกส่วนคลื่นวัฏจักรของข้อมูลตัวแปรต่างๆ ออกแล้ว จะคัดเลือกคลื่นวัฏจักรในแต่ละกลุ่มอีกครั้งหนึ่ง	นักวิชาการพาณิชย์	1. รายงานโครงการศึกษาและจัดทำดัชนีชี้นำวัฏจักรธุรกิจระยะกลางและดัชนีวัฏจักรเงินเฟ้อสำหรับประเทศไทย
7	5 วัน/เดือน	แบ่งกลุ่มตัวแปร	ใช้ทฤษฎีเศรษฐศาสตร์แบ่งตัวแปรออกเป็น 3 กลุ่ม คือ กลุ่มตัวแปรพ่วงภาวะเศรษฐกิจ กลุ่มตัวแปรชี้ภาวะเศรษฐกิจ และกลุ่มตัวแปรตามภาวะเศรษฐกิจ	นักวิชาการพาณิชย์	1. รายงานโครงการศึกษาและจัดทำดัชนีชี้นำวัฏจักรธุรกิจระยะกลางและดัชนีวัฏจักรเงินเฟ้อสำหรับประเทศไทย
8	20 วัน/เดือน	ศึกษา วิเคราะห์ความสัมพันธ์ของตัวแปร	ตรวจสอบความถูกต้องของตัวแปรที่ใช้เป็นส่วนประกอบของดัชนีแต่ละชุด ด้วยวิธีการกำลังสองน้อยที่สุด (Method of least squares)	นักวิชาการพาณิชย์	1. รายงานการศึกษาข้อมูลที่ใช้ประมวลผลดัชนีวัฏจักร
9	1 วัน/เดือน	จัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจ/ดัชนีวัฏจักรเงินเฟ้อ	ใช้โปรแกรมสำเร็จรูปประมวลผล	นักวิชาการพาณิชย์	โปรแกรมประมวลผลดัชนี
10	1 วัน/เดือน	วิเคราะห์จัดทำรายงาน	วิเคราะห์ความถูกต้องของดัชนี จัดทำรายงานดัชนีดัชนีวัฏจักรธุรกิจ/ดัชนีวัฏจักรเงินเฟ้อ	นักวิชาการพาณิชย์	รายงานดัชนีประจำเดือน
11	1 วัน/เดือน	บริการ/เผยแพร่	เผยแพร่ดัชนีวัฏจักรธุรกิจ/เงินเฟ้อ ทุกวันทำการที่ 1 ของเดือนถัดไป ตามช่องทาง บริการต่างๆ	นักวิชาการพาณิชย์	1. เว็บไซต์ www.price.moc.go.th 2. รายงานดัชนีดัชนีวัฏจักรธุรกิจ/ดัชนีวัฏจักรเงินเฟ้อรายเดือน

บริการข้อมูลดัชนีวัฏจักรธุรกิจ/เงินเฟ้อ

	ระเบียบปฏิบัติงาน	เลขที่เอกสาร สค.07.01
	หน่วยงาน : สำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า (กลุ่มดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจ)	แก้ไขครั้งที่ 03
	เรื่อง : การจัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจและวัฏจักรเงินเฟ้อ	หน้าที่ 6/14

6. มาตรฐานการปฏิบัติงาน

6.1 กำหนดวัตถุประสงค์

นักวิชาการพาณิชย์ เป็นผู้กำหนดวัตถุประสงค์ ของการจัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจและดัชนีวัฏจักรเงินเฟ้อ เพื่อนำมาใช้เป็นเครื่องมือวิเคราะห์ภาวะเศรษฐกิจปัจจุบัน และคาดการณ์ภาวะเศรษฐกิจในระยะสั้น และระยะกลาง ซึ่งจะประ โยชน์กับผู้ที่เกี่ยวข้องทั้งภาครัฐบาล และภาคเอกชน โดยสามารถนำไปใช้ในการวางนโยบาย และกำหนดเป้าหมายทางเศรษฐกิจและธุรกิจต่อไป ระยะเวลาที่ใช้ศึกษาจัดทำ จำนวน 3 วัน/ ครั้ง/การจัดทำดัชนี

6.2 กำหนดปีฐาน

นักวิชาการพาณิชย์เป็นผู้พิจารณากำหนดปีฐานให้ชัดเจน เพื่อใช้เป็นจุดเริ่มต้นสำหรับเปรียบเทียบค่าดัชนีโดยใช้ดัชนีราคาผู้บริโภคเป็นตัวปรับ การกำหนดให้ปีใดปีหนึ่งเป็นปีฐาน จะพิจารณาปีที่ระบบเศรษฐกิจมีเสถียรภาพ ระดับราคาเป็นไปตามภาวะอุปสงค์ อุปทานของระบบเศรษฐกิจ เช่น ดัชนีราคาผู้บริโภคกำหนดปีฐานตามปีที่มีการสำรวจภาวะเศรษฐกิจและสังคมของครัวเรือนของสำนักงานสถิติแห่งชาติ กำหนด 1 ครั้ง/เมื่อมีการปรับปรุงปีฐาน/ใช้เวลา 2 วัน


6.3 คัดเลือกตัวแปร มีหลักเกณฑ์ ดังนี้

6.3.1 มีนัยสำคัญทางเศรษฐกิจ (Economic Significance)

ข้อมูลที่ใช้เป็นตัวแปรของดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจรวมได้ดี ข้อมูลนั้นจะต้องแสดงพฤติกรรมในอดีตที่สอดคล้องกับภาวะเศรษฐกิจที่เกิดขึ้นได้เป็นอย่างดี ข้อมูลทุกตัวที่ถูกคัดเลือกขึ้นมา นั้นจะต้องเป็นปัจจัยทางเศรษฐกิจ โดยพิจารณาว่าเป็นข้อมูลที่เป็นไปตามทฤษฎีทางเศรษฐศาสตร์ หรือ สมมุติฐานทางเศรษฐศาสตร์ที่ได้ทำการศึกษาไว้แล้ว อีกทั้งจะต้องเป็นข้อมูลที่ครอบคลุมและสะท้อนภาวะเศรษฐกิจได้อย่างชัดเจน ให้มีความสำคัญเป็นลำดับจากมากไปหาน้อย ดังนี้

6.3.1.1 เป็นข้อมูลที่สามารถครอบคลุมภาวะเศรษฐกิจรวมได้เป็นอย่างดี ได้แก่ข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับ

- ภาคอุตสาหกรรมและการค้า
- ธุรกิจโดยรวมของประเทศ
- สินค้าที่ทำการซื้อขาย
- การบริโภค
- การลงทุน

	ระเบียบปฏิบัติงาน	เลขที่เอกสาร สด.07.01
	หน่วยงาน : สำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า (กลุ่มดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจ)	แก้ไขครั้งที่ 03
	เรื่อง : การจัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจและวัฏจักรเงินเฟ้อ	หน้าที่ 7/14

6.3.1.2 เป็นข้อมูลที่ครอบคลุมเพียงบางส่วนมิได้รวมทั้งระบบเศรษฐกิจกำหนดไว้ได้แก่ข้อมูลเกี่ยวกับ ปริมาณการผลิต การจำหน่ายของสินค้าอุตสาหกรรมเพียงโรงงานใด โรงงานหนึ่ง

6.3.2 ความพร้อมมูลในทางสถิติ (Statistical Adequacy)

ความพร้อมมูลทางสถิติของตัวแปรมีความสำคัญอย่างยิ่งเพราะจะเป็นหลักประกันว่าข้อมูลนั้นมีความถูกต้องแม่นยำ ทำให้การจัดทำดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจ สามารถชี้ให้เห็นสิ่งที่เกิดขึ้นในอดีตที่ผ่านมา และพยากรณ์สิ่งที่เกิดขึ้นในอนาคตได้อย่าง ถูกต้อง แม่นยำ โดยแยกออกเป็น

6.3.2.1 ระบบการรายงาน (Reporting System)

ระบบการรายงานเป็นการพิจารณาว่าข้อมูลนั้นๆมีการนำเสนอรายงาน โดยรวมทั้งหมดหรือนำเสนอเฉพาะบางส่วน เช่น ยอดจำหน่ายสินค้าทั้งหมด หรือยอดขายสินค้าเฉพาะบางรุ่น บางยี่ห้อเท่านั้น ให้ความสำคัญเป็นลำดับจากมากไปหาน้อย ดังนี้

- (1) ข้อมูลนั้นเป็นการรายงานโดยภาพรวมทั้งระบบเศรษฐกิจ
- (2) ข้อมูลนั้นรายงานเฉพาะบางส่วนไม่ครอบคลุมรายการ
- (3) ได้จากแหล่งข้อมูลที่มีได้เป็นผู้จัดทำโดยตรง


6.3.2.2 กระบวนการจัดเก็บครอบคลุมทั้งระบบ (Coverage of process)

ในการเก็บรวบรวมข้อมูลทางเศรษฐกิจต่างๆที่นำมาศึกษาจะต้องมีการจัดเก็บจากทุกหน่วยนับหรืออาจเก็บจากตัวอย่างแต่ต้องมีวิธีการจัดเก็บอย่างเป็นระบบเป็นไปตามหลักวิชาการ แยกเป็นให้ความสำคัญเป็นลำดับจากมากไปหาน้อย ดังนี้

- (1) เป็นข้อมูลที่เก็บจากทุกหน่วยนับ
- (2) เป็นข้อมูลที่จัดเก็บโดยระบบสุ่มตัวอย่าง อย่างมีระบบ
- (3) เป็นข้อมูลเก็บจากตัวอย่าง
- (4) เป็นข้อมูลที่จัดเก็บโดยบังเอิญ

6.3.2.3 ระยะเวลาในการจัดเก็บ (Coverage of Time period)

ตัวเลขข้อมูลสถิติทางเศรษฐกิจที่หน่วยงานต่างๆจัดทำขึ้นมีมากมายหลายชนิด แต่ข้อมูลที่สามารถชี้วัดภาวะเศรษฐกิจได้อย่างแท้จริงควรเป็นข้อมูลที่จัดเก็บโดยมีความถี่อย่างเป็นระบบ กล่าวคือ หากข้อมูลนั้นเป็นตัวแทนของรายเดือนควรมีความถี่ในการจัดเก็บทุกวัน ทุกสัปดาห์ มิใช่เป็นข้อมูลที่จัดเก็บเพียงวันใดวันหนึ่งของสัปดาห์หรือของวัน แล้วใช้เป็นตัวแทนของรายเดือน ซึ่งจะทำให้ดีที่สุดควรเป็นข้อมูลที่เก็บขึ้นทุกวันแล้วรวบรวมเป็นรายเดือน

	ระเบียบปฏิบัติงาน	เลขที่เอกสาร สด.07.01
	หน่วยงาน : สำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า (กลุ่มดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจ)	แก้ไขครั้งที่ 03
	เรื่อง : การจัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจและวัฏจักรเงินเฟ้อ	หน้าที่ 8/14

6.3.2.4 การวัดความคลาดเคลื่อน (A measure of the total error)

ในการจัดเก็บข้อมูลปัจจัยที่สำคัญประการหนึ่งคือการวัดความคลาดเคลื่อนหรือเบี่ยงเบนที่เกิดขึ้นเนื่องจากข้อมูลเศรษฐกิจที่นำมาศึกษาเพื่อนำไปจัดทำดัชนีสำหรับชี้วัดภาวะเศรษฐกิจของประเทศดังนั้นหากข้อมูลเหล่านั้นมีความคลาดเคลื่อนจะส่งผลกระทบต่อพยากรณ์เศรษฐกิจเป็นอย่างมาก

6.3.2.5 ความคลาดเคลื่อน (Measure of error)

ข้อมูลที่จัดเก็บขึ้นมาโดยหน่วยงานต่าง ๆ อาจเกิดความคลาดเคลื่อนโดยตั้งใจและไม่ตั้งใจ ขึ้นอยู่กับว่าหน่วยงานที่จัดเก็บมีวิธีการจัดทำเป็นอย่างไร ให้ความสำคัญเป็นลำดับจากมากไปหาน้อย ดังนี้

- (1) เป็นการจัดเก็บจากข้อมูลทุกหน่วยนับ
- (2) เป็นการจัดเก็บจากการสุ่มตัวอย่าง

6.3.2.6 การอธิบายวิธีการจัดทำ (Description of Method)

ข้อมูลที่หน่วยงานต่าง ๆ จัดทำขึ้นจะต้องมีคำอธิบายวัตถุประสงค์ในการจัดทำข้อมูล เพื่ออะไร จัดเก็บโดยวิธีใด จากแหล่งใด มีความถี่แบบใด เพื่อทราบความหมายของข้อมูลนั้น ๆ อย่างละเอียด การคัดเลือกตัวแปรในทางเศรษฐกิจเพื่อจัดทำดัชนีชี้วัดภาวะเศรษฐกิจ จำเป็นต้องทราบรายละเอียดและคำจำกัดความของตัวแปรนั้นอย่างชัดเจน

6.3.2.7 ความยาวของข้อมูล (Duration of series)

ความยาวของข้อมูลมีส่วนสำคัญมากในการจัดทำดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจ เนื่องจากการศึกษาภาวะเศรษฐกิจ เพื่อจัดทำเครื่องชี้วัดภาวะเศรษฐกิจ และพยากรณ์เศรษฐกิจที่จะเกิดขึ้นในอนาคตโดยวิธีการนี้ จำเป็นต้องใช้ข้อมูลในอดีตเป็นหลักสำคัญ หากข้อมูลมีความยาวมาก จะได้รับการพิจารณาก่อนข้อมูลที่มีความยาวน้อยกว่า

6.3.2.8 ความต่อเนื่องของข้อมูล (Comparability over time)

ในการจัดเก็บข้อมูลของบางหน่วยงานขาดความต่อเนื่อง หรือหากต่อเนื่องก็อาจจะมีการปรับปรุงเพิ่มลดบางสิ่งบางอย่างในแต่ละช่วงเวลา ให้ความสำคัญเป็นลำดับจากมากไปหาน้อย ดังนี้

- (1) เป็นข้อมูลที่ต่อเนื่องอย่างสม่ำเสมอ
- (2) เป็นข้อมูลที่มีการปรับปรุง 1 ครั้ง
- (3) เป็นข้อมูลที่ปรับปรุง 2 ครั้ง
- (4) ไม่มีการปรับปรุงข้อมูลอย่างน้อย 15 ปี

	ระเบียบปฏิบัติงาน	เลขที่เอกสาร ศค.07.01
	หน่วยงาน : สำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า (กลุ่มดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจ)	แก้ไขครั้งที่ 03
	เรื่อง : การจัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจและวัฏจักรเงินเฟ้อ	หน้าที่ 9/14

6.3.3 มีความมั่นคง (Conformity)

ข้อมูลตัวแปรทางเศรษฐกิจที่ถูกคัดเลือกขึ้นมาจะต้องสามารถยืนยันพฤติกรรมในอดีตของข้อมูลได้ดีไม่ว่าจะมีทิศทางการเปลี่ยนแปลงของเศรษฐกิจไปทางใด ตัวแปรที่คัดเลือกมาใช้จัดทำดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจจะต้องมีความมั่นคงในรูปแบบของวัฏจักรเศรษฐกิจในอดีตมาโดยตลอด กล่าวคือ ข้อมูลจะมีทิศทางเพิ่มขึ้นเมื่ออยู่ในช่วงเศรษฐกิจขยายตัว ขณะเดียวกันหากเศรษฐกิจอยู่ในภาวะถดถอยข้อมูลนั้นก็จะต้องมีทิศทางลดลง

สำหรับตัวแปรที่เป็นตัวชี้นำเศรษฐกิจจะต้องชี้นำ(Leading) ทุกวงจรของวัฏจักร ส่วนตัวแปรที่มีลักษณะคล้อยตาม (Lagging) ก็จะต้องคล้อยตามทุกวงจรของวัฏจักร เช่นกัน

ตัวแปรที่ถูกคัดเลือกขึ้นมาจะต้องมีคุณสมบัติสอดคล้องไปกับวัฏจักรเศรษฐกิจทุก ๆ วงจรที่เกิดขึ้นในอดีตที่ผ่านมาโดยตลอด เพื่อที่จะสามารถนำมาสร้างแบบจำลองพยากรณ์เศรษฐกิจในอนาคตได้อย่างถูกต้องแม่นยำ ประกอบด้วย

6.3.3.1 ความน่าจะเป็น (Conformity Probability)

6.3.3.2 จุกวากลับ (Extra Turns) สม่าเสมอ

6.3.3.3 การวากกลับหันเหจุดไปจากเดิม

6.3.3.4 ขนาดช่วงกว้างของคลื่นวัฏจักร (Amplitude)


6.3.4 ระยะเวลาของวัฏจักร (Timing)

ในการศึกษาถึงพฤติกรรมของวัฏจักรเศรษฐกิจที่เกิดขึ้นในช่วงเวลาต่าง ๆ ตัวแปรบางตัวจะมีลักษณะนำเศรษฐกิจในขณะที่บางตัวคล้อยตามภาวะเศรษฐกิจซึ่งความสัมพันธ์เหล่านี้เป็นปัจจัยสำคัญมากที่จะนำไปใช้ในการพยากรณ์เศรษฐกิจที่จะเกิดขึ้นในอนาคต ตามระบบคัดเลือกตัวแปรโดยให้คะแนนนั้น พฤติกรรมของตัวแปรจะต้องเป็นไปโดยปกติ และสม่าเสมอ สามารถสังเกตเห็นได้อย่างชัดเจน ทั้งที่เป็นตัวชี้นำ ผกผัน รุนแรง ชี้นำ และคล้อยตาม โดยปรากฏให้เห็นในช่วงวัฏจักรวากกลับที่มีช่วงความยาวที่วัดเฉลี่ยในแต่ละครั้ง

การที่จะพิจารณาว่าเป็นตัวแปรชี้นำหรือชี้นำภาวะเศรษฐกิจให้วัดจากการเปรียบเทียบช่วงเวลาแต่ละเดือนของวัฏจักรสูงสุดและต่ำสุด กล่าวคือตัวชี้นำจะต้องวากกลับก่อนที่พฤติกรรมของเศรษฐกิจจะเกิดขึ้น ส่วนตัวคล้อยตามก็จะเกิดหลังจากพฤติกรรมปกติเกิดขึ้นแล้ว สังเกตได้จากการเกิดก่อนหรือหลังจุกวากลับ 3 เดือนขึ้นไป แบ่งประเด็นในการพิจารณา เป็น 3 ช่วงคือ

6.3.4.1 ขณะที่เศรษฐกิจสูงสุด (At business Cycle peaks) แยกเป็น

- (1) ความน่าจะเป็น (Probability)
- (2) การกระจาย (Dispersion)
- (3) การผิดพลาด (Lapses)

	ระเบียบปฏิบัติงาน	เลขที่เอกสาร ศค.07.01
	หน่วยงาน : สำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า (กลุ่มดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจ)	แก้ไขครั้งที่ 03
	เรื่อง : การจัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจและวัฏจักรเงินเฟ้อ	หน้าที่ 10/14

6.3.4.2 ขณะที่เศรษฐกิจต่ำสุด (At business cycle troughs)

6.3.4.3 ณ จุดสูงสุดและต่ำสุด (At peaks and troughs)

6.3.5 ความเป็นปัจจุบัน (Currency)

ข้อมูลตัวแปรที่นำมาศึกษาจะต้องเป็นปัจจุบันคือ มีการเก็บรวบรวมและเผยแพร่ในระยะเวลาที่รวดเร็วต่อเนื่อง ไม่ควรล่าช้าเกินไป แยกเกณฑ์ในการให้คะแนนในความเป็นปัจจุบันของข้อมูลให้ความสำคัญเป็นลำดับจากมากไปหาน้อย ดังนี้

6.3.5.1 เป็นข้อมูลรายเดือน (Monthly Series)

6.3.5.1.1 ความทันสมัยของข้อมูล (Promptness) ประกอบด้วย

- (1) ข้อมูลชุดนั้นสามารถเผยแพร่เดือนต่อเดือน
- (2) ข้อมูลชุดนั้นเผยแพร่ล่าช้า 2 เดือน
- (3) ข้อมูลมีการเผยแพร่ล่าช้ามาก

6.3.5.1.2 เป็นข้อมูลรายวัน รายสัปดาห์ หรือราย 10 วัน แล้วรวมเฉลี่ยเป็น

ข้อมูลรายเดือน

6.3.5.2 เป็นข้อมูลรายไตรมาส ประกอบด้วย

6.3.5.2.1 ข้อมูลชุดนั้นสามารถเผยแพร่ในช่วงสิ้นเดือนของแต่ละไตรมาส

6.3.5.2.2 ข้อมูลชุดนั้น เผยแพร่ในเดือนที่ 2 หลังจากสิ้นไตรมาสแล้ว

6.3.5.2.3 ข้อมูลล่าช้า

6.3.6 ความราบเรียบของข้อมูล (Smoothness)


ข้อมูลที่จัดทำเครื่องชี้เศรษฐกิจที่ดีควรจะมีการเคลื่อนไหวในลักษณะที่ราบเรียบ ไม่ผันผวนผิดปกติเกินไปเนื่องจากในช่วงที่เกิดวิกฤตการณ์ทางเศรษฐกิจ ข้อมูลมักจะมีค่าผิดปกติเกิดขึ้นค่อนข้างมาก

การศึกษาความราบเรียบของข้อมูลได้จากอัตราการเปลี่ยนแปลงเฉลี่ยในแต่ละเดือนของข้อมูลชุดนั้น (Month-to-month changed) เรียกว่า Cyclical significance หรือ นัยสำคัญของวงจรวัฏจักร เป็นการคำนวณอัตราการเปลี่ยนแปลงโดยเฉลี่ยของความผิดปกติของข้อมูล (Irregular) เมื่อเทียบกับวัฏจักร (Cyclical) ของข้อมูล โดยมีสูตรในการคำนวณคือ

$$MCD = \bar{I} / \bar{C}$$

\bar{I} อัตราการเปลี่ยนแปลงเฉลี่ยของความผิดปกติ

\bar{C} คืออัตราการเปลี่ยนแปลงเฉลี่ยของวัฏจักร

	ระเบียบปฏิบัติงาน	เลขที่เอกสาร สค.07.01
	หน่วยงาน : สำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า (กลุ่มดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจ)	แก้ไขครั้งที่ 03
	เรื่อง : การจัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจและวัฏจักรเงินเฟ้อ	หน้าที่ 11/14

MCD (Month for Cyclical Dominance) เป็นการเปรียบเทียบอัตราการเปลี่ยนแปลงของข้อมูลแต่ละเดือนกับช่วงเดือนที่ผ่านมาเพื่อแสดงถึงความแปรปรวนของข้อมูลว่ามีอิทธิพลเหนือวัฏจักรตัวมันเองกี่เดือน

ในการจัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจที่จะต้องนำข้อมูลตัวแปรต่าง ๆ มารวมกัน เพื่อสร้างเป็นแบบจำลองเศรษฐกิจ ตัวแปรทุกตัวควรมีค่า MCD ต่ำเพื่อว่าการพยากรณ์เศรษฐกิจในอนาคตจะแม่นยำ เนื่องจากอิทธิพลของความคลาดเคลื่อนหากมีมากกว่าจริงวัฏจักรจะทำให้การพยากรณ์ในเดือนต่อไปมีความแม่นยำลดลง โดยกำหนดให้ค่า MCD ไม่ควรเกิน 5 ใช้ระยะเวลา 5 วัน/ครั้ง/เมื่อมีการปรับปรุง

6.4 จัดเก็บและรวบรวมข้อมูล/บันทึก

นักวิชาการพาณิชย์ มีหน้าที่จัดเก็บ และรวบรวม ข้อมูลสถิติทางด้านเศรษฐกิจ ที่หน่วยงานต่าง ๆ จัดทำ และเผยแพร่เป็นรายเดือน และรายไตรมาส บันทึกลงฐานข้อมูล ใช้ระยะเวลา 15 วัน/เดือน

6.5 แยกส่วนคลื่นวัฏจักรจากข้อมูลอนุกรมเวลา

นักวิชาการพาณิชย์จะทำการวิเคราะห์อนุกรมเวลา (Time Series Analysis) โดยการแยกคลื่นวัฏจักรออกจากข้อมูลอนุกรมเวลา ซึ่งข้อมูลอนุกรมเวลาจะประกอบด้วยส่วนต่าง ๆ ดังนี้

6.5.1 ส่วนความแปรปรวน (Irregular Component, I) คือส่วนของข้อมูลที่มีการเคลื่อนไหวหรือเปลี่ยนแปลงในระยะสั้น ๆ หรือกะทันหันและไม่มีรูปแบบที่แน่นอน ซึ่งเป็นส่วนที่ไม่สามารถคาดเดาได้


6.5.2 ส่วนฤดูกาล (Seasonal Component, S) คือส่วนของข้อมูลที่มีการเคลื่อนไหวหรือเปลี่ยนแปลงในลักษณะเดียวกันเป็นประจำทุกปี

6.5.3 ส่วนแนวโน้ม (Trend Component, T) คือส่วนของข้อมูลที่แสดงทิศทางการเคลื่อนไหวหรือเปลี่ยนแปลงในระยะยาว

6.5.4 ส่วนคลื่นวัฏจักร (Cyclical Component, C) คือส่วนของข้อมูลที่เบี่ยงเบนจากเส้นแนวโน้มของตัวเองออกไปทั้งในแนวบวกและแนวลบก่อตัวเป็นคลื่นวัฏจักร โดยธรรมชาติและลักษณะของคลื่นวัฏจักรของแต่ละตัวแปรจะแตกต่างกันไปขึ้นอยู่กับ การปรับตัวของตัวแปรนั้นต่อผลกระทบของปัจจัยต่าง ๆ ทั้งทางโครงสร้างเศรษฐกิจและสังคม

ส่วนประกอบเหล่านี้จะมีความสัมพันธ์อยู่ในรูปของผลคูณ (Multiplicative Form) นั่นคือข้อมูลอนุกรมเวลาใด ๆ X_t จะเขียนอยู่ในรูปความสัมพันธ์ได้ดังนี้

$$X_t = I_t \times S_t \times T_t \times C_t$$

	ระเบียบปฏิบัติงาน	เลขที่เอกสาร สค.07.01
	หน่วยงาน : สำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า (กลุ่มดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจ)	แก้ไขครั้งที่ 03
	เรื่อง : การจัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจและวัฏจักรเงินเฟ้อ	หน้าที่ 12/14

ในการจัดทำดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจนั้น ใช้ข้อมูลที่กำจัดฤดูกาลและความแปรปรวนออกไปแล้วใช้ระยะเวลา 5 วัน/ครั้ง/เมื่อมีการปรับปรุง

6.6 คัดเลือกวัฏจักร

เมื่อแยกส่วนคลื่นวัฏจักรของข้อมูลตัวแปรต่าง ๆ ออกแล้ว จะคัดเลือกคลื่นวัฏจักรในแต่ละกลุ่มอีกครั้งหนึ่ง โดยมีหลักเกณฑ์ที่ใช้พิจารณา ดังนี้

6.6.1 เป็นคลื่นที่แสดงถึงจุดวกกลับต่าง ๆ ชัดเจน

6.6.2 สามารถแยกคลื่นออกเป็นวัฏจักรได้ (1 วัฏจักร คือระยะระหว่าง จุดสูงสุดจุดหนึ่งถึงจุดสูงสุดถัดไป)

6.6.3 จุดวกกลับที่เกิดขึ้นจะต้องไม่มากเกินไปหรือน้อยเกินไป เมื่อเทียบกับคลื่นวัฏจักรของตัวแปรอื่น ๆ ในกลุ่มเดียวกัน ใช้ระยะเวลา 3 วัน/ครั้ง/เมื่อมีการปรับปรุง


6.7 แบ่งกลุ่มตัวแปร

ใช้ทฤษฎีเศรษฐศาสตร์แบ่งตัวแปรออกเป็น 3 กลุ่ม ดังนี้ คือ

6.7.1 กลุ่มตัวแปรฟองภาวะเศรษฐกิจ คือ กลุ่มของตัวแปรที่มีลักษณะการเคลื่อนไหวและการเปลี่ยนแปลงในระยะเวลาใกล้เคียงสอดคล้องกับภาวะเศรษฐกิจรวมของประเทศ เช่น ข้อมูลปริมาณการผลิตต่าง ๆ ข้อมูลการบริโภค เป็นต้น

6.7.2 กลุ่มตัวแปรชี้นำภาวะเศรษฐกิจ คือ กลุ่มของตัวแปรที่มีลักษณะการเคลื่อนไหวและการเปลี่ยนแปลงของข้อมูลในลักษณะนำหรือก่อนภาวะเศรษฐกิจของประเทศ เช่น ข้อมูลพื้นที่ขออนุญาตก่อสร้างใหม่ ดัชนีราคาหุ้น ข้อมูลคำสั่งใหม่ (new order) เป็นต้น

6.7.3 กลุ่มตัวแปรตามภาวะเศรษฐกิจ คือ กลุ่มของตัวแปรที่มีลักษณะการเคลื่อนไหวและการเปลี่ยนแปลงของข้อมูลในลักษณะตามหลังภาวะเศรษฐกิจ เช่น ข้อมูลเงินกู้เพื่อการพาณิชย์ และอุตสาหกรรม เป็นต้น ใช้ระยะเวลา 5 วัน/ครั้ง/เมื่อมีการปรับปรุง

	ระเบียบปฏิบัติงาน	เลขที่เอกสาร ศด.07.01
	หน่วยงาน : สำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า (กลุ่มดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจ)	แก้ไขครั้งที่ 03
	เรื่อง : การจัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจและวัฏจักรเงินเฟ้อ	หน้าที่ 13/14

6.8 ศึกษา วิเคราะห์ ความสัมพันธ์ของกลุ่มตัวแปร

นักวิชาการพาณิชย์ ทำการศึกษา และวิเคราะห์ กลุ่มตัวแปร โดยการนำตัวแปรที่ใช้เป็นส่วนประกอบของดัชนีแต่ละชุด มาหาความสัมพันธ์ด้วยวิธีกำลังสองน้อยที่สุด (Method of least squares) และทำการเขียนรายงานวิเคราะห์ความสัมพันธ์ดังกล่าว ว่ามีความถูกต้องตามหลักเศรษฐมิติหรือไม่ โดยจะนำผลที่ได้จากการศึกษาไปปรับใช้ในการจัดทำดัชนีวัฏจักรฯ ที่สำนักฯ จัดทำอยู่เดิมให้แม่นยำยิ่งขึ้น ใช้ระยะเวลา 20 วัน/ครั้ง/ปี

6.9 จัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจ และดัชนีวัฏจักรเงินเฟ้อ

นักวิชาการพาณิชย์ ใช้โปรแกรมสำเร็จรูปประมวลผลข้อมูลดังนี้

- (1) นำข้อมูลมากำจัดฤดูกาล และความแปรปรวน โดยใช้โปรแกรม X-12-ARIMA
- (2) ประมวลผลดัชนี โดยจัดสร้างดัชนีรวม (Composite Index) ใช้สูตร

$$R_t = \sum_{i=2}^n w_i S_{i,t} / \sum_{i=2}^n w_i$$

โดยที่

R_t = ค่าดัชนีรวม (Composite Index)

w_i = น้ำหนักของตัวแปร โดยให้เท่ากับ 1 สำหรับทุกเครื่องชี้ i

$S_{i,t}$ = การเปลี่ยนแปลงของเครื่องชี้รายเดือนที่ปรับด้วยค่ามาตรฐานแล้ว

- (3) กำหนดปีฐาน และให้ดัชนีอยู่ในรูปร้อยละ


ใช้ระยะเวลา 1 วัน/เดือน

6.10 วิเคราะห์ และจัดทำรายงาน

นักวิชาการพาณิชย์ มีหน้าที่ ตรวจสอบวิเคราะห์ดัชนี รายงานการเคลื่อนไหวของดัชนีวัฏจักรธุรกิจและวัฏจักรเงินเฟ้อ และจัดทำรายงานนำเสนอในรูปกราฟและตารางและทำเอกสารนำเสนอ ต่อผู้อำนวยการสำนักฯ จัดทำเอกสารเผยแพร่ รวมทั้งทำ Excel file สำหรับ upload ขึ้นเว็บไซต์ ใช้ระยะเวลาดำเนินการ 1 วัน/เดือน

6.11 บริการและเผยแพร่

นักวิชาการพาณิชย์ มีหน้าที่บริการและเผยแพร่ดัชนีทุกวันที่ 1 ของเดือน ผ่านช่องทางบริการเว็บไซต์ของสำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า www.price.moc.go.th โดยนักวิชาการพาณิชย์ upload ขึ้นเว็บไซต์เพื่อให้ผู้ใช้บริการสามารถ download เป็น Excel file ได้

	ระเบียบปฏิบัติงาน	เลขที่เอกสาร สด.07.01
	หน่วยงาน : สำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า (กลุ่มดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจ)	แก้ไขครั้งที่ 03
	เรื่อง : การจัดทำดัชนีวัฏจักรธุรกิจและวัฏจักรเงินเพื่อ	หน้าที่ 14/14

นอกจากนี้มีการจัดส่งรายงานข่าวดัชนีไปยังกลุ่มผู้ใช้ข้อมูลและลูกค้าผ่านทางไปรษณีย์ ระบบโทรศัพท์อัตโนมัติ เอกสารและแผ่นพับ ใช้ระยะเวลาดำเนินการ 1 วัน/เดือน

7. เอกสารอ้างอิง

7.1 รายงานการวิเคราะห์เปรียบเทียบผลการคำนวณดัชนีวัฏจักรธุรกิจและดัชนีวัฏจักรเงินเพื่อ จากการจัดอิทธิพลของปัจจัยฤดูกาล (Seasonal Adjust) ด้วยวิธีการต่างๆ

7.2 รายงาน โครงการศึกษาและจัดทำดัชนีชี้แนวโน้มวัฏจักรธุรกิจระยะกลางและดัชนีวัฏจักรเงินเพื่อ สำหรับประเทศไทย

7.3 รายงานการศึกษาผลกระทบของฤดูกาล (Seasonal) และวันทำการ (Trading Day) โดยใช้ โปรแกรม X-12-SEATS และ X-12-ARIMA

7.4 การพยากรณ์เงินเฟ้อของประเทศไทย ด้วยดัชนีชี้แนวโน้มวัฏจักรเงินเพื่อ แบบจำลองโครงสร้าง แบบจำลอง ARIMA และแบบจำลอง VAR

7.5 การใช้โปรแกรมประมวลผลดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจ

7.6 รายงานการศึกษาข้อมูลที่ใช้ประมวลผลดัชนีวัฏจักรเศรษฐกิจ

8. แบบฟอร์มที่ใช้

-

9. เอกสารบันทึก

ชื่อเอกสาร	ผู้รับผิดชอบ	สถานที่จัดเก็บ	ระยะเวลา	วิธีการจัดเก็บ
รายงานดัชนีวัฏจักรธุรกิจ	นักวิชาการพาณิชย์	1. แฟ้มเอกสาร 2. เครื่องคอมพิวเตอร์ 3. www.price.moc.go.th	1 ปี	เรียงตาม ปี พ.ศ.
รายงานดัชนีวัฏจักรเงินเพื่อ	นักวิชาการพาณิชย์	1. แฟ้มเอกสาร 2. เครื่องคอมพิวเตอร์ 3. www.price.moc.go.th	1 ปี	เรียงตาม ปี พ.ศ.