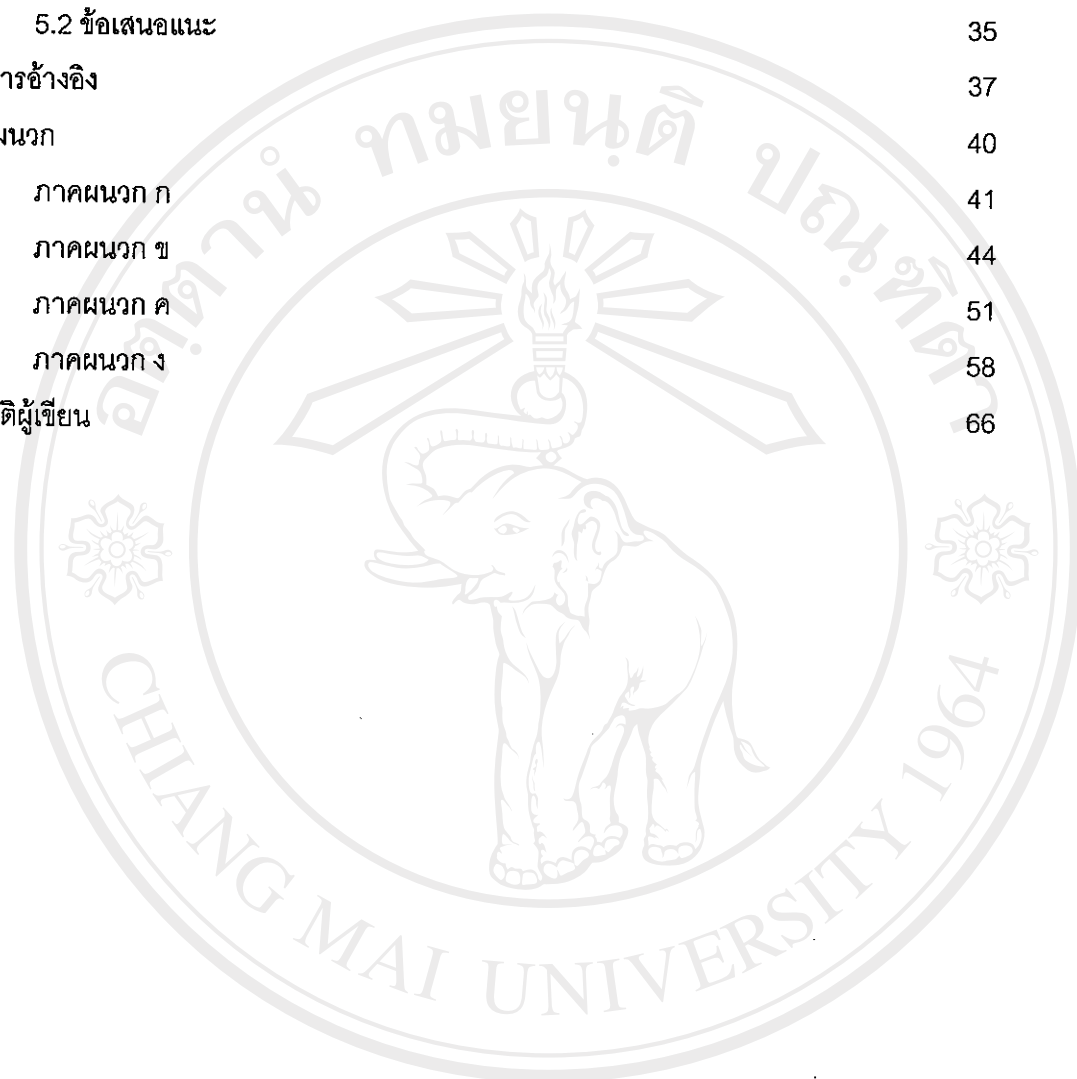


สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ญ
สารบัญรูป	ฎ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	6
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ	6
1.4 ขอบเขตการศึกษา	6
บทที่ 2 งานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	
2.1 สรุปสาระสำคัญจากเอกสารที่เกี่ยวข้อง	7
บทที่ 3 แนวความคิดและระเบียบวิธีวิจัย	
3.1 แนวความคิดเกี่ยวกับการพยากรณ์ข้อมูลอนุกรมเวลา	11
3.1.1 แนวคิดการพยากรณ์ข้อมูลอนุกรมเวลา	11
3.1.2 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล	11
3.1.3 การพยากรณ์โดยวิธี Box-Jenkins	13
3.2 ระเบียบวิธีวิจัย	9
บทที่ 4 ผลการศึกษา	
4.1 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล	20
4.2 การกำหนดแบบจำลองอาร์มา	23
4.2.1 การกำหนดแบบจำลอง	23
4.2.2 การประมาณค่าพารามิเตอร์	25
4.2.3 การตรวจสอบความถูกต้อง	29

4.3 การพยากรณ์	30
บทที่ 5 สรุปและข้อเสนอนะ	
5.1 สรุป	35
5.2 ข้อเสนอนะ	35
เอกสารอ้างอิง	37
ภาคผนวก	40
ภาคผนวก ก	41
ภาคผนวก ข	44
ภาคผนวก ค	51
ภาคผนวก ง	58
ประวัติผู้เขียน	66



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright© by Chiang Mai University
 All rights reserved

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
1.1 ดัชนีผลผลิตอุตสาหกรรม	2
1.2 อัตราการใช้กำลังการผลิตภาคอุตสาหกรรม	2
1.3 มาตรการด้านภาษีอากรในการฟื้นฟูธุรกิจอสังหาริมทรัพย์ ปี 2540 – 2545	3
1.4 ปริมาณการใช้ปูนซีเมนต์ในประเทศไทย ตั้งแต่ปี พ.ศ. 2543-2546	4
1.5 ปริมาณการใช้เหล็กในประเทศไทย ตั้งแต่ปี พ.ศ. 2543-2546	4
1.6 การจำหน่ายเครื่องสุขภัณฑ์และกระเบื้องปูพื้นภายในประเทศ	5
3.1 การพิจารณา ACF และ PACF	15
4.1 ผลการทดสอบ Unit Root โดยใช้ค่า ADF Test Statistic	22
4.2 ค่าทางสถิติของแบบจำลอง	24
4.3 ค่าสถิติของแบบจำลอง	29
4.4 การเปรียบเทียบค่าสถิติจากการพยากรณ์	30
4.5 ผลการพยากรณ์ดัชนีราคาวัสดุก่อสร้าง	31
4.6 ผลการพยากรณ์ดัชนีราคา 3 ช่วง	34

สารบัญภาพ

รูป	หน้า
3.1 ขั้นตอนการพยากรณ์โดยวิธี Box- Jenkins	14
3.2 ช่วงเวลาที่ใช้ในการพยากรณ์	19
3.3 ช่วงเวลาที่ใช้ในการพยากรณ์จริง	20
4.1 ผลการพยากรณ์ดัชนีราคาวัสดุก่อสร้างในอนาคต	32
4.2 ลักษณะการเคลื่อนไหวของข้อมูลจริงและค่าที่ได้จากการคำนวณ	33

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved