

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ค
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	ฉ
สารบัญตาราง	ญ
สารบัญภาพ	ฎ
บทที่ 1 บทนำ	
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	7
1.3 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากการศึกษา	7
1.4 ขอบเขตการศึกษา	8
1.5 การเก็บรวบรวมข้อมูล	8
บทที่ 2 สรุปสาระสำคัญของผลงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	
2.1 งานวิจัยที่เกี่ยวข้องกับการส่งออกปลาทูน่ากระป๋อง	9
2.2 งานวิจัยที่เกี่ยวข้องกับการวิเคราะห์และพยากรณ์ด้วยแบบจำลอง ARIMA	23
บทที่ 3 แนวความคิดและระเบียบวิธีวิจัย	
3.1 แนวความคิดที่ใช้ในการศึกษา	26
3.1.1 แนวคิดการวิเคราะห์ข้อมูลอนุกรมเวลา (Time-Series Analysis)	26
3.1.2 การทดสอบความนิ่งของข้อมูลอนุกรมเวลา (Unit Root Test)	29
3.2.3 การพยากรณ์ข้อมูลอนุกรมเวลา โดยวิธี Box – Jenkins	31
3.2 ระเบียบวิธีวิจัย	40

บทที่ 4	ผลการศึกษา	
4.1	การทดสอบ Unit Root	43
4.2	การพยากรณ์โดยแบบจำลอง ARIMA	45
4.2.1	การกำหนดรูปแบบของแบบจำลอง (Identification)	45
4.2.2	ขั้นตอนการประมาณค่าพารามิเตอร์ในรูปแบบ (Estimation)	46
4.2.3	การตรวจสอบความถูกต้อง (Diagnostic Checking)	52
4.2.4	การพยากรณ์ (Forecasting)	53
บทที่ 5	สรุปผลและข้อเสนอแนะ	
5.1	สรุปผลการศึกษา	58
5.2	ข้อเสนอแนะ	59
	เอกสารอ้างอิง	61
	ภาคผนวก	66
	ภาคผนวก ก มูลค่าการส่งออกปลาพุงน้ำกระป๋อง	67
	ภาคผนวก ข ผลการทดสอบความนิ่งของข้อมูล	70
	ภาคผนวก ค ผลคอเรลโลแกรม	77
	ภาคผนวก ง ค่าสถิติการประมาณค่าพารามิเตอร์	100
	ประวัติผู้เขียน	111

สารบัญตาราง

ตาราง	หน้า
1.1 สินค้าส่งออกสำคัญ 20 รายการแรกของไทย ปี พ.ศ. 2546 – 2549 (ม.ค.-ก.ค.)	3
1.2 มูลค่าการส่งออกอาหารทะเลกระป๋องของไทย ปี พ.ศ. 2546 – 2549 (ม.ค.-ก.ค.)	4
1.3 ปริมาณและมูลค่าการส่งออกปลาทูน่ากระป๋องของไทย ปี พ.ศ. 2539 – 2548	4
1.4 ตลาดส่งออกปลาทูน่ากระป๋องที่สำคัญของไทย ปี พ.ศ. 2547 – 2549 (ม.ค.-ก.ค.)	6
3.1 แสดงการพิจารณา ACF และ PACF	34
4.1 แสดงผลการทดสอบ unit root ของปลาทูน่ากระป๋อง โดยวิธี ADF-test	44
4.2 ค่าสถิติสำคัญที่ได้จากขั้นตอนการกำหนดรูปแบบและการประมาณค่าพารามิเตอร์	46
4.3 แสดงค่า Q-statistic ของแบบจำลอง	52
4.4 แสดงค่าสถิติจากการพยากรณ์ในช่วง historical forecast	53
4.5 แสดงค่าสถิติจากการพยากรณ์ในช่วง ex-post forecast	54
4.6 ผลพยากรณ์มูลค่าการส่งออกปลาทูน่ากระป๋องที่ได้จากแบบจำลอง AR(1) AR(2) SAR(12) SMA(12)	56

สารบัญภาพ

รูป	หน้า
1.1 มูลค่าการส่งออกปลาทูน่ากระป๋องรายเดือนของไทย ปี พ.ศ. 2534 – 2549 (ม.ค.-พ.ค.)	5
3.1 ขั้นตอนการพยากรณ์โดยวิธี Box-Jenkins	33
3.2 แสดงช่วงเวลาที่ใช้ในการพยากรณ์	39
3.3 แสดงช่วงเวลาที่ใช้ในการพยากรณ์จริง	42
4.1 แสดงมูลค่าการส่งออกปลาทูน่ากระป๋องจริงและมูลค่าที่พยากรณ์ได้จากแบบจำลอง AR(1) AR(2) SAR(12) SMA(12)	55
4.2 แสดงมูลค่าการส่งออกปลาทูน่ากระป๋องจริงและมูลค่าที่พยากรณ์ได้จากแบบจำลอง AR(1) AR(2) SAR(12) SMA(12) ตั้งแต่เดือนตุลาคม 2548 ถึงเดือนกันยายน 2549	57