

สารบัญ

	หน้า
กิตติกรรมประกาศ	ก
บทคัดย่อภาษาไทย	ง
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ	จ
สารบัญตาราง	ฉ
สารบัญภาพ	ฐ
บทที่ 1 บทนำ	1
1.1 ที่มาและความสำคัญของปัญหา	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการศึกษา	7
1.3 ประโยชน์ที่จะได้รับจากการศึกษา	7
1.4 ขอบเขตการศึกษา	7
1.5 การเก็บรวบรวมข้อมูล	7
1.6 นิยามศัพท์	7
บทที่ 2 ผลงานวิจัยที่เกี่ยวข้อง	9
บทที่ 3 กรอบทฤษฎีและระเบียบวิธีวิจัย	16
3.1 ทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง	16
3.1.1 การวิเคราะห์หอนุกรมเวลา (time series analysis)	16
3.1.2 แนวคิดการพยากรณ์ข้อมูลอนุกรมเวลา	17
3.1.3 การทดสอบความนิ่งของข้อมูล (unit root test)	19
3.1.4 การทดสอบความนิ่งแบบเป็นฤดูกาลของข้อมูล (seasonal unit root test)	22
3.1.5 แบบจำลองการพยากรณ์ โดยวิธี Box – Jenkins	23
3.2 ระเบียบวิธีวิจัย	30

บทที่ 4	พฤติกรรมการณ์เคลื่อนไหวของมูลค่าเสื้อผ้าสำเร็จรูปส่งออก	33
4.1	ความสำคัญของอุตสาหกรรมเสื้อผ้าสำเร็จรูปไทย	33
4.1.1	วิธีการตลาดของการค้าเสื้อผ้าสำเร็จรูป	36
4.1.2	การนำเข้า และการส่งออกเสื้อผ้าสำเร็จรูป	36
4.2	พฤติกรรมการณ์เคลื่อนไหวของมูลค่าเสื้อผ้าสำเร็จรูปส่งออก	40
4.2.1	แนวโน้ม (Trend : T)	41
4.2.2	การเคลื่อนไหวตามฤดูกาล (Seasonal movement: S)	42
4.2.3	การเคลื่อนไหวตามวัฏจักร (Cyclical movement: C)	43
4.2.4	ความเคลื่อนไหวผิดปกติ (Irregular movement: I)	44
บทที่ 5	ผลการวิเคราะห์แบบจำลอง ARIMA	46
5.1	ผลการทดสอบ unit root test	46
5.2	การทดสอบความนิ่งแบบเป็นฤดูกาลของข้อมูล (seasonal unit root est)	47
5.3	แบบจำลอง ARIMA	50
1.	การกำหนดรูปแบบ (identification)	50
2.	การประมาณ (estimation)	51
3.	การตรวจสอบความถูกต้อง (diagnostics checking)	67
4.	การพยากรณ์ (forecasting)	68
5.4	แบบจำลอง ARIMA (ข้อมูลรายไตรมาส)	77
1.	การกำหนดรูปแบบ (identification)	77
2.	การประมาณ (estimation)	77
3.	การตรวจสอบความถูกต้อง (diagnostics checking)	82
4.	การพยากรณ์ (forecasting)	83
บทที่ 6	บทสรุปและข้อเสนอแนะ	89
6.1	สรุปผลการศึกษา	89
6.2	ข้อจำกัด	90
6.3	ข้อเสนอแนะ	91

เอกสารอ้างอิง

92

ภาคผนวก

94

ประวัติผู้เขียน

107



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

สารบัญตาราง

ตาราง		หน้า
1.1	สินค้าส่งออกสำคัญ 10 รายการแรกของไทย ปี 2544-2548 (ม.ค.-มี.ค.)	2
1.2	อัตราการขยายตัวและสัดส่วนของการส่งออกสินค้า 20 รายการแรกของประเทศไทย	3
1.3	มูลค่า และอัตราการขยายตัวของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศในภาคอุตสาหกรรมเสื้อผ้าสำเร็จรูป (ณ ราคา คงที่ 2531) ระหว่างปี พ.ศ. 2541-2544	4
1.4	สัดส่วนของอุตสาหกรรมเสื้อผ้าสำเร็จรูปต่อ GDP และต่อภาคอุตสาหกรรมสิ่งทอ	4
3.1	ตารางค่าสถิติของ Hylleberg et al.1990	23
3.2	ตารางการพิจารณา ACF และ PACF	25
4.1	คู่มือการค้าสิ่งทอและเสื้อผ้าสำเร็จรูป	33
4.2	สถิติการส่งออกสินค้าอุตสาหกรรมเสื้อผ้าสำเร็จรูปไทย	34
4.3	มูลค่า และอัตราการขยายตัวของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศในภาคอุตสาหกรรมเสื้อผ้าสำเร็จรูป (ณ ราคา คงที่ 2531) ระหว่างปี พ.ศ. 2541-2544	35
4.4	สัดส่วนของอุตสาหกรรมเสื้อผ้าสำเร็จรูปต่อ GDP และต่อภาคอุตสาหกรรมสิ่งทอ	35
4.5	การนำเข้า อัตราการขยายตัว และสัดส่วนของมูลค่าเสื้อผ้าสำเร็จรูปของไทย จำแนกตามประเทศนำเข้าที่สำคัญ ระหว่างปี 2545-2548	38
4.6	การส่งออก อัตราการขยายตัว และสัดส่วนของมูลค่าเสื้อผ้าสำเร็จรูปของไทย จำแนกตามประเทศส่งออกที่สำคัญ ระหว่างปี 2545-2548	38
4.8	ค่าความไหวเคลื่อนตามฤดูกาล	43
5.1	ค่าสถิติที่ใช้ในการทดสอบ unit root test	46
5.2	ค่าสถิติสำหรับการทดสอบ seasonal unit root	48
5.3	ค่า Q-statistic ที่ได้จากการทดสอบความเหมาะสมของแบบจำลอง	68
5.4	การเปรียบเทียบค่าสถิติจากการพยากรณ์ในช่วง Historical Forecast	69
5.5	การเปรียบเทียบค่าสถิติที่สำคัญในการประเมินค่าพารามิเตอร์จากแบบจำลอง	70

5.6	ผลพยากรณ์มูลค่าการส่งออกเสื้อผ้าสำเร็จรูปจากแบบจำลอง AR(1) AR(13) MA(12) ในช่วง Ex-ante forecast	75
5.7	ผลพยากรณ์มูลค่าการส่งออกเสื้อผ้าสำเร็จรูปจากแบบจำลอง AR(1) AR(13) MA(12) ในแต่ละช่วง	76
5.8	ค่า Q-statistic ที่ได้จากการทดสอบความเหมาะสมของแบบจำลอง	83
5.9	การเปรียบเทียบค่าสถิติจากการพยากรณ์ในช่วง Historical Forecast	84
5.10	การเปรียบเทียบค่าสถิติที่สำคัญในการประเมินค่าพารามิเตอร์จากแบบจำลอง	84
5.11	ผลพยากรณ์มูลค่าการส่งออกเสื้อผ้าสำเร็จรูปจากแบบจำลอง AR(2) SAR(4) MA(9) ในช่วง Ex-ante forecast	87
5.12	ผลพยากรณ์มูลค่าการส่งออกเสื้อผ้าสำเร็จรูปจากแบบจำลอง AR(2) SAR(4) MA (9) ในแต่ละช่วง	88

สารบัญภาพ

รูป	หน้า
1.1 มูลค่าการส่งออกเสื้อผ้าสำเร็จรูปรายเดือนของประเทศไทยตั้งแต่ปี พ.ศ. 2537 – พ.ศ. 2547	6
3.1 ช่วงเวลาที่ใช้ในการพยากรณ์	30
3.2 ช่วงเวลาที่ใช้ในการพยากรณ์จริง	31
3.3 แผนภูมิแสดงขั้นตอนการวิจัยโดยวิธี Box – Jenkins	32
4.1 ค่าแนวโน้มมูลค่าส่งออกเสื้อผ้าสำเร็จรูปตั้งแต่ปี พ.ศ. 2537 – ปี พ.ศ.2548	41
4.2 ค่าการเคลื่อนไหวตามวัฏจักรของมูลค่าส่งออกเสื้อผ้าสำเร็จรูปตั้งแต่ปี พ.ศ. 2537 – ปี พ.ศ.2548	44
4.3 ค่าความเคลื่อนไหวผิดปกติของมูลค่าส่งออกเสื้อผ้าสำเร็จรูปตั้งแต่ปี พ.ศ. 2537 – ปี พ.ศ.2548	45
5.1 การทดสอบ Seasonal Unit Root ของมูลค่าส่งออกเสื้อผ้าสำเร็จรูป (ระดับ level)	48
5.2 การทดสอบ Seasonal Unit Root ของมูลค่าส่งออกเสื้อผ้าสำเร็จรูป (1 st difference)	49
5.3 การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มา SAR(12) SMA(12)	52
5.4 การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มา AR(1) SAR(12) SMA(12)	53
5.5 การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มา AR(1) AR(2) SAR(12) SMA(12)	54
5.6 การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มา AR(1) AR(2) AR(3) SAR(12) SMA(12)	55
5.7 การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มา AR(1) AR(3) SAR(12) SMA(12)	56
5.8 การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มา SAR(12) MA(1) SMA(12)	57
5.9 การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มา SAR(12) MA(1) MA(2) SMA(12)	58
5.10 การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มา SAR(12) MA(1) MA(2) MA(3) SMA(12)	59
5.11 การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มา AR(1) AR(2) AR(3) SAR(12) MA(1) SMA(12)	60
5.12 การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มา AR(1) AR(2) AR(3) SAR(12) MA(1) MA(2) SMA(12)	61

5.13	การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มีมา AR(1) SAR(12) MA(1) MA(2) MA(3) SMA(12)	62
5.14	การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มีมา AR(1) AR(2) SAR(12) MA(1) MA(2) MA(3) SMA(12)	63
5.15	การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มีมา AR(1) AR(2) AR(3) SAR(12) MA(1) MA(2) MA(3) SMA(12)	64
5.16	การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มีมา AR(1) SAR(2) MA(1)	65
5.17	การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มีมา AR(1) AR(13) MA(12)	66
5.18	เปรียบเทียบมูลค่าส่งออกเสื้อผ้าสำเร็จรูประหว่างมูลค่าจริงกับมูลค่าที่พยากรณ์ได้ โดยใช้แบบจำลองสมการที่ 5.5.4 และ 5.5.5	71
5.19	เปรียบเทียบมูลค่าส่งออกเสื้อผ้าสำเร็จรูประหว่างมูลค่าจริงกับมูลค่าที่พยากรณ์ได้ โดยใช้แบบจำลองสมการที่ 5.5.9 และ 5.5.13	72
5.20	ผลการพยากรณ์มูลค่าส่งออกของเสื้อผ้าสำเร็จรูปในช่วง Historical forecast	73
5.21	ผลการพยากรณ์มูลค่าการส่งออกเสื้อผ้าสำเร็จรูปในช่วง Ex-Post forecast	74
5.22	ผลการพยากรณ์มูลค่าการส่งออกเสื้อผ้าสำเร็จรูป ในช่วง Ex-ante forecast	75
5.23	การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มีมา SAR(2) SMA(3) MA(7) MA(10)	78
5.24	การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มีมา AR(2) MA(1) MA(4)	79
5.25	การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มีมา AR(1) AR(2) MA(4)	80
5.26	การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มีมา AR(1) AR(2) MA(2) MA(4)	81
5.27	การประมาณค่าแบบจำลองอาร์มีมา AR(2) SAR(4) MA(9)	82
5.28	ผลการพยากรณ์มูลค่าส่งออกของเสื้อผ้าสำเร็จรูปในช่วง Historical forecast	85
5.29	ผลการพยากรณ์มูลค่าส่งออกของเสื้อผ้าสำเร็จรูปในช่วง Ex-post forecast	86
5.30	ผลการพยากรณ์มูลค่าการส่งออกเสื้อผ้าสำเร็จรูป ในช่วง Ex-ante forecast	87