

รายการอ้างอิง

ภาษาไทย

จรัญ จันทลักขณา. สถิติ วิธีวิเคราะห์และวางแผนงานวิจัย. กรุงเทพมหานคร: สำนักพิมพ์
ไทยวัฒนาพานิช, 2534.

ชูใจ อุหารคณไชย. การวิเคราะห์ความถดถอยเมื่อความคลาดเคลื่อนของข้อมูลมีสหสัมพันธ์และ
ความแปรปรวนไม่คงที่. วิทยานิพนธ์ปริญญาโทบริหารธุรกิจ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย,
2531.

ดาว คงศิริวัฒนา. การเปรียบเทียบอำนาจการทดสอบของตัวสถิติ สำหรับทดสอบความ
คลาดเคลื่อนที่มีความแปรปรวนไม่คงที่ ในการวิเคราะห์ความถดถอยเชิงเส้น.
วิทยานิพนธ์ปริญญาโทบริหารธุรกิจ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2532.

ไพศาล หวังพาณิชย์. วิธีการวิจัย. กรุงเทพมหานคร: มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ, 2530.

นิภา ศรีไพโรจน์. สถิติเงินตราและเศรษฐกิจ. กรุงเทพมหานคร: สำนักพิมพ์โอเดียนสโตร์, 2533.

วินัส พีชวณิชย์. ทฤษฎีความน่าจะเป็นและการประยุกต์. กรุงเทพมหานคร: สำนักพิมพ์
ประกายพริก, พิมพ์ครั้งที่ 5, 2535.

สมจิต วัฒนาชยากุล. การวิเคราะห์ข้อมูลเชิงสถิติ. กรุงเทพมหานคร: สำนักพิมพ์ประกายพริก,
2527.

สุพล ศุรงค์วัฒนา. การวิเคราะห์เชิงสถิติ การวิเคราะห์ความแปรปรวน. กรุงเทพมหานคร:
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2537.

สรชัย พิศาตบุตร. สถิติเพื่อการวิเคราะห์และการวิจัย. กรุงเทพมหานคร: ศูนย์ส่งเสริมวิชาการ.
_____ รองคณบดีคณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี. สัมภาษณ์, 10 มีนาคม 2539.

ภาษาอังกฤษ

Kelton, W.D., Law, A.M., Simulation Modeling and Analysis. New York McGraw-Hill
Book Company, 1991.

Montgomery. DC Design And Analysis of Experiments (second editor). Wiley: New York

Ghosh, M., and Meeden, G., Empirical Bayes Estimation in finite population sampling .

Journal of Amer. Statist. Assoc. 81(1986): 1058-1062.

Kleffe, J., and Rao, J.N.K. . Estimation of the Mean Square Error of Empirical Best Linear Unbiased Predictions under a Random Error Variance Linear Model. Journal of Multivariate Analysis 43,(1992) : 1-15.

Prasad ,N.G.N. ,and Rao,JNK .The estimation of Mean Square Error of Small Area Estimators Journal of American Statist. Assoc. 55, (1990) : 163-171.



ศูนย์วิทยทรัพยากร
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

ภาคผนวก

การผลิตเลขสุ่มโดยใช้โปรแกรม

ในการสร้างตัวแปรให้มีคุณสมบัติตามต้องการ วิธีหนึ่ง คือเทคนิคของการผลิตเลขสุ่ม โดยใช้โปรแกรม คือ

1). การผลิตเลขสุ่มโดยใช้โปรแกรม

เป็นการผลิตเลขสุ่มจากความสัมพันธ์ ที่ซ้ำ (Reourrence relative) โปรแกรมย่อยที่ใช้ คือ RAND(IX) ซึ่ง IX คือเลขสุ่มที่เป็นค่าเริ่มต้นที่เข้าไปในโปรแกรมย่อยต้องเป็นจำนวนเต็มบวกที่เป็นเลขคู่ IX เป็นค่า SEED ซึ่งเลขสุ่มถัดไป ที่คำนวณได้จากเลขสุ่มตัวเริ่มต้นเลขสุ่มที่ได้มีการแจกแจงสม่ำเสมอในช่วง (0 , 1)

ซึ่งสร้างโปรแกรมย่อย RAND เขียนได้ดังนี้

```
IX = IX * 16807
IF (IX.LT.0) IX = IX + 2147483647 +1
RAND = IX
RAND = RAND*0.465661E-9
RETURN
END
```

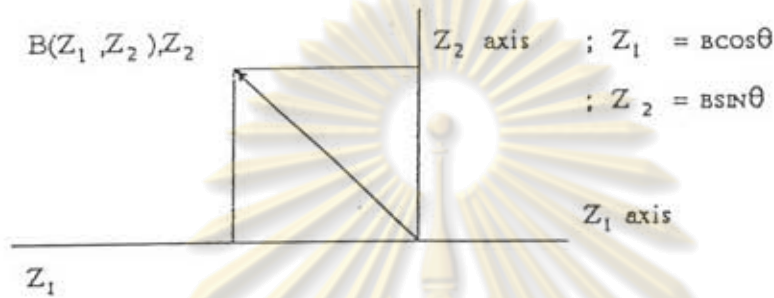
2). การผลิตเลขสุ่มที่มีการแจกแจงปกติ

การแจกแจงปกติโดยเทคนิคแบบการแปลงโดยตรวจสอบ

$$f(\chi^2) = \int_{-\infty}^{\infty} \frac{1}{2} \exp(-\chi^2/2) d\chi \quad ; -\infty < x < \infty$$

- ∞

Box และ Muller (1958) สร้างเลขสุ่มที่มีการแจกแจงแบบปกติสมมาตร ที่มีค่าเฉลี่ย เท่ากับ ME ความแปรปรวน เท่ากับ VA พร้อมกัน 2 ค่า ดังนั้น



$B^2 = Z_1^2 + Z_2^2$ มีการแจกแจงโคไซน์แควร์ ชั้นความเป็นอิสระ 2 เทียบกับการแจกแจง เอ็กโปเนนเชียล (Exponential distribution) ด้วยค่าเฉลี่ย 2 รัศมี B มีค่า

$$B = (-2 \text{LN } R)^{\frac{1}{2}}$$

โดยการสมมาตรของการแจกแจงปกติ (normal distribution) θ มีการแจกแจง สม่ำเสมอ (Uniformly distribution) ระหว่าง $(0, 2\pi)$ เรเดียน ค่า B และ θ เป็น Mutually independent

ศูนย์วิจัยทรัพยากร
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

$$Z_1 = (-2 \text{LN } R_1) * \text{COS}(2\pi R_2)$$

$$Z_2 = (-2 \text{LN } R_1) * \text{SIN}(2\pi R_2)$$

ฟังก์ชันสำหรับจำลองประชากรที่มีการแจกแจงแบบปกติมีค่าเฉลี่ย μ ความแปรปรวน σ จะเรียกใช้ NORM1 (ME,VA,EX) จะได้ค่า $XX = \text{ZONE} * \text{VA} + \text{ME}$ หรือ $\text{NORMAL} = \text{ZTWO} * \text{VA} + \text{ME}$ ในแต่ละครั้ง ดังนั้นคำสั่งในการสร้างตัวแปร ให้มีการแจกแจงแบบปกติ

ซึ่งสร้างโปรแกรมย่อย NORM เขียน ได้ดังนี้

```

SUBROUTINE NORM ( ME,VA,EX)
SD = SQRT(VA)
PI = 3.1415926
IF (KK.EQ.1) GO TO 10
RONE = RAND(IX)
RTWO = RAND(IX)
ZONE = SQRT(-2*ALOG(RONE))*COS(2*PI*RTWO)
ZTWO = SQRT(-2*ALOG(RONE))*SIN(2*PI*RTWO)
EX = ZONE*SD + ME
KK = 1
GO TO 15
10 EX = ZTWO*SD + ME
KK = 0
15 RETURN
END

```

3). การผลิตเลขสุ่มที่มีการแจกแจงโคสแควร์
การแจกแจงโคสแควร์โดยเทคนิคการแปลงโดยตรงสอด

จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

$$f(\chi^2) = \frac{2^{-B/2}}{\Gamma(B/2)} (\chi^2)^{\frac{(B-2)}{2}} \exp(-\frac{1}{2}\chi^2)$$

$$; \chi^2 > 0$$

$$; \sigma_{i,c} \sim \chi^2 (\beta, \alpha)$$

$$; i = 1, 2, \dots, m$$

; β เป็นชั้นความเป็นอิสระ

; exp หรือ e เป็นจำนวนอตรรกยะ (irrational) มีค่าประมาณ 2.71828

ซึ่งสร้างโปรแกรมย่อย CHISQ เขียนได้ดังนี้

```
C-----C
C                               C
C                               C
C-----C
```

```

SUBROUTINE CHISQ( DF,CHI )
COMMON/SEED/IX, KK
CON1 = FLOAT( 1 )/SQRT( DF - 1 )
CON2 = DF/2 - ALOG( 4. )
CON3 = DF/2 + 1/CON1
CON4 = 1 +ALOG( 4.5 )
1 U1 = RAND(IX)
  U2 = RAND(IX)
  CHI1 = CON1*ALOG(U1/(1 - U1))
  CHI2 = ( DF/2 )*EXP( CHI1 )
  CHI3 = ( U1**2 )*U2
  CHI4 = CON2 + CON3*CHI1 -CHI2
  IF ((CHI4 + CON4 -4.5*CHI3).GE.0) THEN
    CHI = 2*CHI2
  ELSE IF(CHI4.GE.ALLOG(CHI3)) THEN
    CHI = 2*CHI2
  ELSE
    GOTO 1
  END IF
RETURN
END
```

ศูนย์วิทยทรัพยากร
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

.1 (MAY 1985) VS FORTRAN DATE: APR 10, 1995 TIME: 13:28:14

C-----C
C-----C
C-----C
C-----C

MAIN PROGRAM

N EFFECT:	NOLIST	NOMAP	NOXREF	NOGOSTMT	NODECK	SOURCE	NOTERM	OBJECT	FIXED	NOTEST	N
	NO SYM	NORENT	SDUMP	AUTODD	(NONE)	NCSXM	IL				
	OPT(0)	LANGVL(77)	NOFIPS	FL(3(1))	NAME(MAIN)			LINECUNT(60)		CHAR	
	1.....	2.....	3.....	4.....	5.....	6.....	7......	8		

```

1  DIMENSION VAR(100),PDF(100)
2  REAL MEAN
3  COMMON/SEED/IX, KK
4  IX = 2601
5  KK = 0
6  BETA = 5
7  M = 100
8  DO 70 I = 1, M
9    DF = BETA
10   CALL CHI-SQ(DF, CHI)
11   VAR(I) = CHI
12 70 CONTINUE
13   CALL SHEL( VAR, M)
14 71 DO 71 I = 1, M
15   PDF(I) = ((0.5)**(DF/2.)/ GAMMA(DF/2.))*EXP (-VAR(I)/2.)
16   * * VAR(I)**(DF/2.-1.)
17   WRITE (6,*)VAR(I),PDF(I)
18 71 CONTINUE
19   STOP
20   END

```

ศูนย์วิทยทรัพยากร

ภาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

.....
MAY 1985) VS FORTRAN DATE: APR 10, 1995 TIME: 13:28:15
.....

C-----C
C FUNCTION RANDCM C
C-----C

.....
OBJECT: NOLIST NOMAP NOXREF NOGOSTMT NODECK SOURCE NOTERM OBJECT FIXED NOTI
NOSYM NORENT SDUMP AUTOBLIND(=C) NCSXM IL
OPT(0) LANGLVL(77) NOFIPS (L75(1) NAME(MAIN) LINECUNT(60)

..........1.....2.....3.....4.....5.....6.....7.*.....

.....
FUNCTION RAND(IX)
IX = IX*16807
IF(IX.LT.0) IX = IX + 2147483647+1
RAND = IX
RAND = RAND*0.465661E-9
RETURN
END

.....
SOURCE STATEMENTS = 7, PROGRAM SIZE = 666 BYTES, PROGRAM NAME = RAND P,

NO DIAGNOSTICS GENERATED.

.....
OF COMPILATION 2 *****

ศูนย์วิทยทรัพยากร
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

.1 (MAY 1985)

VS FORTRAN

DATE: APR 10, 1995

TIME: 13:20:15

```

C-----C
C          NORMAL DISTRIBUTION          C
C-----C

```

```

IN EFFECT:  NOLIST NOMAP NOXREF NOGOSTHT NODECK  SOURCE NOTERM  OBJECT FIXED  NOTEST
             NOSYM NORENT  SDUMP AUTOOBL(RONE)  NOSXM  IL
             OPT(0) LAMGLVL(77) HGFIPS  FLAG(1) NAME(MAIN ) LINECCUNT(60)  CH.

```

```

#.....1.....2.....3.....4.....5.....6.....7.*.....

```

```

1      SUBROUTINE NORM(ME,VA,EX)
2      COMMON/SEED/IX, KK
3      SD = SQRT(VA)
4      PI = 3.1415926
5      IF (KK.EC.1) GO TO 10
6      RONE = RAND(IX)
7      RTWO = RAND(IX)
8      ZONE = SQRT(-2*ALOG(RONE))*COS(2*PI*RTWO)
9      ZTWO = SQRT(-2*ALOG(RONE))*SIN(2*PI*RTWO)
10     EX = ZONE*SD + ME
11     KK = 1
12     GOTG 15
13     10 EX = ZTWO*SD + ME
14     KK = 0
15     15 RETURN
16     END

```

```

CS*-----SOURCE STATEMENTS = 16, PROGRAM SIZE = 1240 BYTES, PROGRAM NAME = NORM-----PAGE

```

```

CS* NO DIAGNOSTICS GENERATED.

```

```

END OF COMPILATION 3 *****

```

ศูนย์วิทยทรัพยากร

จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

[MAY 1985]

VS FORTRAN

DATE: APR 10, 1995

TIME: 13:28:15

```

C-----C
C          CHI-SQUARE DISTRIBUTION          C
C-----C

```

```

EFFECT:  NOLIST  NOHAP  NOXREF  NOGOSTMT  NODECK  SOURCE  NOTERM  OBJECT  FIXED  NOTEST
          NOSYM  NORENT  SDUMP  AUTODBL(NONE)  NOSXM  IL
          OPT(C)  LANGVL(77)  NOFIPS  FLAG(I)  NAME(MAIN )  LINECOUNT(60)  CHA

```

```

*.....*...1.....2.....3.....4.....5.....6.....7.*.....8

```

```

1      SUBROUTINE CHISQ(DF,CHI)
2      COMMON/SEED/IX, KK
3      CON1 = FLGAT(1)/SORT(DF-1)
4      CON2 = DF/2 - ALOG(4.)
5      CON3 = DF/2 + 1/CON1
6      CON4 = 1 + ALOG(4.5)
7      1 U1 = RAND(IX)
8      U2 = RAND(IX)
9      CHI1 = CON1*ALOG(U1/(1-U1))
10     CHI2 = (DF/2)*EXP(CHI1)
11     CHI3 = (U1**2)*U2
12     CHI4 = CON2 + CON3*CHI1 - CHI2
13     IF((CHI4 + CON4 - 4.5*CHI3).GE.0)THEN
14         CHI = 2*CHI2
15     ELSE IF(CHI4.GE.ALOG(CHI3))THEN
16         CHI = 2*CHI2
17     ELSE
18         GOTO 1
19     END IF
20     RETURN
21     END

```

```

S*  SOURCE STATEMENTS = 21, PROGRAM SIZE = 1420 BYTES, PROGRAM NAME = CHISQ  PAI

```

ศูนย์วิทยทรัพยากร
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

1 (MAY 1985)

VS FORTRAN

DATE: APR 10, 1995

TIME: 13:28:11

C*****
 C SWAPC
 C*****

EFFECT:	NOPLIST	NOMAP	NOXREF	NOGCSTMT	NODECL	SOURCE	NOTERM	OBJECT	FIXED	N
	NOSYM	NORENT	SDUMP	AUTOOBL(NONE)	NOSXM	IL				
	OPT(0)	LANGLVL(77)	NOFIPS	FLAG(1)	NAME(MAIN)					LINECOUNT(60)
	*	1.....	2.....	2.....	5.....	6.....	7.....	*	..

```

1      SUBROUTINE SWAP(A,B)
2      HOLD = A
3      A = B
4      B = HOLD
5      RETURN
6      END

```

CS* SOURCE STATEMENTS = 6, PROGRAM SIZE = 584 BYTES, PROGRAM NAME = SWAP

CS* NO DIAGNOSTICS GENERATED.

END-OF-COMPILE-5*****

ศูนย์วิทยทรัพยากร
 จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

1 (MAY) 1985)

VS FORTRAN

DATE: APR 10, 1995

TIME: 13:28:15

C*****C
 C-----SHELL-SORTCC-----C
 C*****C

EFFECT:	NOLIST	NOMAP	NOXREF	NOGCSTMT	NODECK	SOURCE	NOTERM	OBJECT	FIXED	NOTEST	NO
	NOSYM	NORENT	SDUMP	AUTODBLINDG	NOSXM	IL					
	OPT(0)	LANGLVL(77)	MOFIPS	FLAG(1)	NAME(MAIN)	LINECOUNT(60)		CHARL			
1.....	2.....	3.....	4.....	5.....	6.....	7......	8			

```

1      SUBROUTINE SHELL(X,N)
2      DIMENSION X(100)
3      JUMP = N
4      25 JUMP = JUMP/2
5      IF (JUMP .EQ. 0) GOTO 99
6      J2 = N - JUMP
7      DO 40 J = 1,J2
8          I = J
9      30      J3 = I + JUMP
10         IF (X(I) .LE. X(J3)) GOTO 40
11             CALL SWAP(X(I),X(J3))
12         I = I - JUMP
13         IF (I .GT. 0) GOTO 30
14     40 CONTINUE
15     GOTO 25
16     99 RETURN
17     END

```

S* SOURCE STATEMENTS = 17, PROGRAM SIZE = 1016 BYTES, PROGRAM NAME = SHELL PA

S* NO DIAGNOSTICS GENERATED.

END OF COMPILATION 6 *****

LAST RETURN CCDE WAS 0000
 // ASSGN SYSC06,CDE
 // EXEC

0.733613968	0.579012701E-01
1.02560997	0.827092520E-01
1.02755070	0.828636239E-01
1.08266830	0.871833563E-01
1.29144192	0.102321804
1.32734989	0.105379164
1.61730957	0.121838510
1.64071369	0.123044431
1.66684055	0.124359846
1.71823978	0.126853883
1.78586102	0.129946807
1.84573746	0.132509599
1.93210602	0.135920227
1.97430406	0.137462437
2.12777138	0.142441571
2.16938972	0.143621147
2.20281219	0.144517541
2.24792480	0.145656324
2.33068275	0.147540367
2.34230614	0.147784650
2.36846542	0.148314476
2.42446709	0.149264293
2.44077682	0.149649786
2.49497032	0.150525368



ศูนย์วิทยทรัพยากร
 จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

2.52001514	0.151010454
2.54554749	0.151252329
2.55243111	0.151344478
2.57653236	0.151654601
2.60316066	0.151574618
2.63180262	0.152294040
2.90215302	0.154054642
2.96245575	0.154162109
3.05639267	0.154140055
3.10236931	0.154040741
3.10426903	0.154043913
3.13702774	0.153946280
3.30976486	0.153030574
3.32669449	0.152906418
3.40396500	0.152266562
3.45176697	0.151813149
3.45889282	0.151741803
3.49873924	0.151226299
3.59818459	0.150168180
3.64750671	0.149532914
3.80455017	0.147263944
3.87846565	0.146076560
3.91500675	0.145462215
3.92181778	0.145347655
3.96016693	0.144693719
3.99849129	0.144002974
4.06330299	0.142014457
4.18486404	0.140460478



ศูนย์วิทยทรัพยากร
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

4.36999512	0.136640131
4.38342285	0.136351764
4.41651344	0.135635053
4.42872620	0.135365653
4.48281479	0.134178753
4.54240417	0.132845591
4.54862404	0.132705152
4.56467819	0.132341683
4.61899185	0.131101668
4.63612747	0.130707204
4.68664169	0.129535913
4.76002502	0.127813280
4.78618240	0.127193923
4.81446828	0.126521051
4.83833885	0.125950933
4.94677734	0.123336971
5.14704132	0.118429482
5.15731812	0.116175337
5.21279335	0.116802096
5.36454582	0.113029490
5.42149925	0.111610413
5.47876358	0.110192941
5.53050041	0.108693573
5.57209396	0.107857764
5.61568642	0.106773078
5.87482788	0.100263970



ศูนย์วิทยทรัพยากร
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

6.04277992	0.962654352E-01
6.08684540	0.251996446E-01
6.12693214	0.942337513E-01
6.40089417	0.877432227E-01
6.68117523	0.813335130E-01
6.81826591	0.782946348E-01
7.28101730	0.685526133E-01
7.29258919	0.683196783E-01
7.29447365	0.682817698E-01
7.32474327	0.676751733E-01
7.69409180	0.605722442E-01
8.04072380	0.544135668E-01
9.11622047	0.383662358E-01
9.21664238	0.370919257E-01
9.33959389	0.355806425E-01
9.42752792	0.345320776E-01
10.9638634	0.200091457E-01
11.9848576	0.137803145E-01
12.1029486	0.121777152E-01
13.2530452	0.849700719E-02
14.8181572	0.459470972E-02
15.4953289	0.350204832E-02



ศูนย์วิทยทรัพยากร
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

1 0 *DATA LIST FREE RECORD=1/X Y
 2 0 DATA LIST FIXED RECPD=1/X 12-21 (7) Y 34-42 (3)

THE ABOVE DATA LIST STATEMENT WILL READ 1 RECORDS FROM FILE SYSIN

VARIABLE	REC	START	END	FORMAT	WIDTH	DEC
X	1	12	21	F	10	7
Y	1	34	42	F	9	8

END OF DATALIST TABLE.

3 0 LIST

THERE ARE 902680 BYTES OF MEMORY AVAILABLE.
 THE LARGEST CONTIGUOUS AREA HAS 902680 BYTES.

170 BYTES OF MEMORY REQUIRED FOR LIST PROCEDURE.
 104 BYTES HAVE ALREADY BEEN ACQUIRED.
 66 BYTES REMAIN TO BE ACQUIRED.

10 APR 95 SPSS-X RELEASE 2.1 FOR IBM DCS/VSE - 16 DEC 85
 12:23:15 COMPUTER SERVICE CENTER, CHULA ANDAUL 5860-16M DCS/VSE 3.1

จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

DATE 10/04/95,CLOCK 12/

```

/ JOB EAD10003
/ EXEC PROC=SPSSX
/ LIBDEF *,SEARCH=(PF02.SPSSX21)
/ OPTION_NODUMP
/ DLBL SPSSERR,'SPSSX.ERRORS',,VSAM,CAT=VSESPUC
/ DLBL SPSSINF,'SPSSX.INFO',,VSAM,CAT=VSESPUC      UPLATE, LOCAL
/ DLBL SYSUT1,'LABELS.WORK',0,VSAM,RECSIZE=1016,RECORDS=(100,100)
/ EXTENT      ,SYSWK1
/ DLBL SYSUT2,'DATA.WORK1',0,VSAM,RECSIZE=1016,RECORDS=(800,800)
/ EXTENT      ,SYSWK1
/ DLBL SYSUT3,'DATA.WORK2',0,VSAM,RECSIZE=1016,RECORDS=(800,800)
/ EXTENT      ,SYSWK1
/ DLBL SYSUT4,'PROC.WORK',0,VSAM,RECSIZE=1016,RECORDS=(100,100)
/ EXTENT      ,SYSWK1
/ DLBL SORTWK1,'DOS.WORKFILE.SYS.SORT.WORK',0,VSAM,RECSIZE=1016,RECORDS=(1000,1000)
/ EXTENT      ,SYSWK1

```

JP SPSSX

/ EXEC SPSSX

```

SSSSSS PPPPPPPP SSSSSSS SSSSSSS XX XX 222222 1
SSSSSS PPPPPPPP SSSSSSS SSSSSSS XX XX 22222222 11
SS PP PP SS SS SS SS XX XX 22 22 111
PP PP SS SS XX XX 22 11
SSSSSS PPPPPPPP SSSSSSS SSSSSSS == XX 22 11
SSSSSS PPPPPPPP SSSSSSS SSSSSSS == XX 22 11
SS PP SS SS XX XX 22 11
SS PP SS SS SS SS XX XX 22 11
SSSSSS PP SSSSSSS SSSSSSS XX XX 22222222 .. 1111
SSSSSS PP SSSSSSS SSSSSSS XX XX 22222222 .. 1111

```

R DOS/VSE 3.1

COMPUTER SERVICE CENTER, CHULALONGKORN

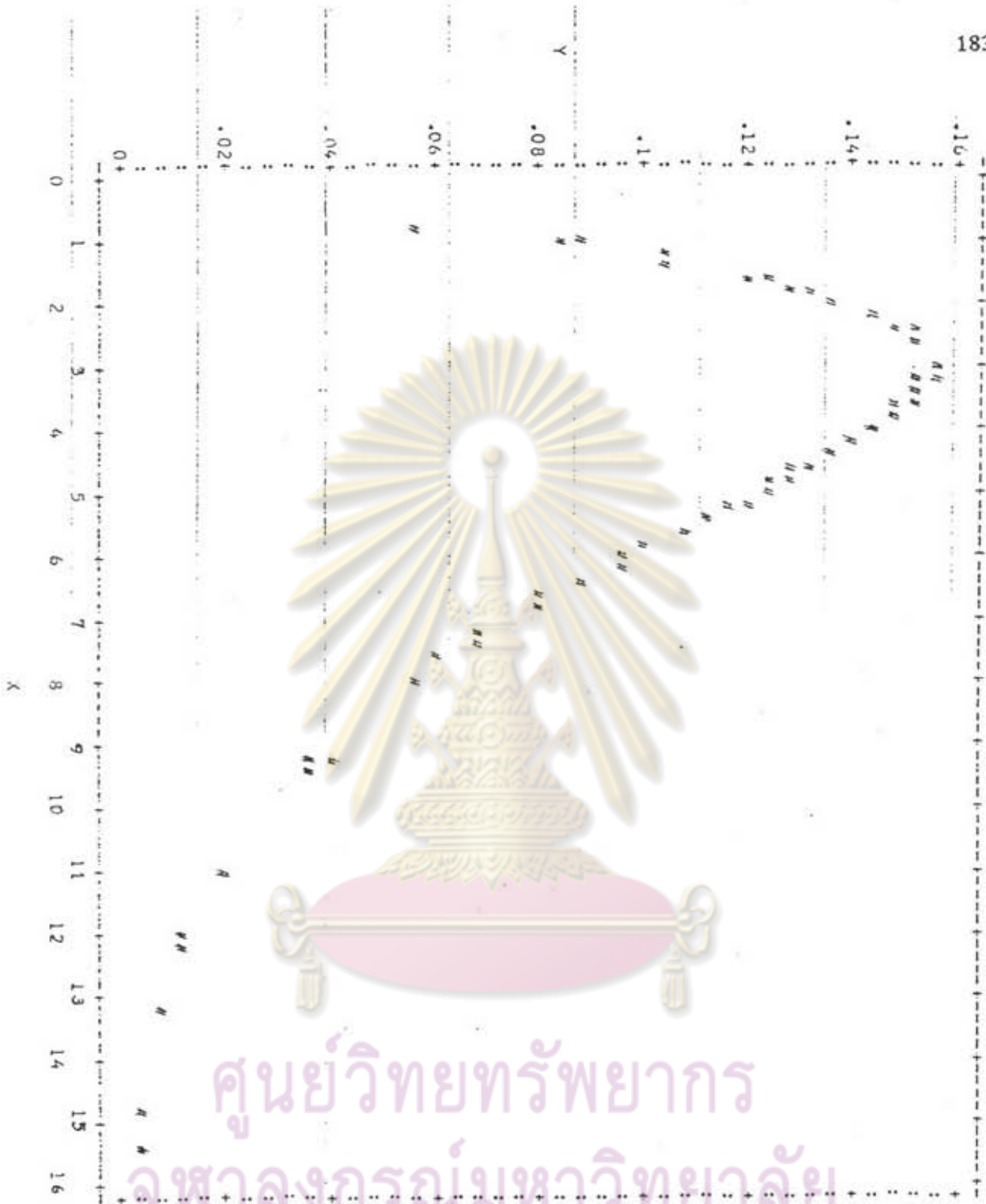
LICENSE NUMBER 61596

E THE SPSS-X USER'S GUIDE, 2ND ED., FOR MORE INFORMATION ON:

```

ALSCAL: MULTIDIMENSIONAL SCALING * UPDATE TRANSACTIONS TO SYSTEM FILES
TIME AND DATE FORMATS AND FUNCTIONS * EXPORT FOR DATA COMMUNICATIONS
MULTIPUNCHED DATA AND BIT FIELDS * SIMPLIFIED REGRESSION COMMAND

```



ศูนย์วิทยทรัพยากร
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

โปรแกรมที่ใช้ในการคำนวณงานวิจัย

โปรแกรมที่ใช้ในการคำนวณงานวิจัยเพื่อจำลองสถานการณ์ที่กำหนด มี 4 โปรแกรม

คือ

1) วิธีกำลังสองน้อยที่สุด

โปรแกรมที่ใช้ในการคำนวณงานวิจัย มีรายละเอียดดังนี้

```

C-----C
C          -MAIN PROGRAM          C
C-----C
C          DIMENSION VAR (300),AVAR(300),MEAN(300),YYY(300),ERROR(300),
C          *A(300),Y(300),H(300),T(300),EE(300),EBB(300)
C          REAL MEAN,MSE,RMEANL
C          COMMON/SEED/IX,KK,N
C          IX = 2601
C          KK = 0
C-----C
C          BETA = 2,3,4,5,6 ; NUMBER OF TREATMENT (M) = 3,5,7,9,25,30,35
C-----C
C          BETA = 5
C          M = 30
C          RMEAN = 0.0
C          SSE = 0.0
C-----C
C          ORDINARY LEAST SQUARE METHOD -ESTIMATE- MSE UNDER C
C          THE ASSUMPTION OF UNEQUALLY ERROR VARIANCE      C
C-----C
C          DO 100 BKLM = 1,4979
C          YY = 0.0
C          TT = 0.0
C          SUMV = 0.0
C          N = 3
C          DO 50 I = 1,M
C          SUMY = 0.0
C          SUMYY = 0.0

```

```

SUMT = 0.0
... DF = BBTA
... CALL CHISQ( DF,CHI)
... VAR(1) = CHI
... MB = 1.
... VA = 1.
... CALL NORM( MB,VA,EX)
MEAN(1) = EX
DF = N - 1
CALL CHISQ( DF,CHI)
A(1) = CHI
AVAR(1) = (A(1)*VAR(1)) / DF
DO 50 K = 1,N
ME = 0.
VA = AVAR(1)
... CALL NORM( -MB,VA,EX)
... ERROR( K ) = EX
... Y( K ) = MEAN( 1 ) + ERROR( K )
... H( K ) = Y( K )
... T( K ) = MEAN( 1 )
... SUMY = SUMY + H( K )
... SUMT = SUMY + T( K )
50 CONTINUE
EE(1) = SUMY / N
SUMZA(1) = SUMT / N
YY = YY + EE(1) / M
TT = TT + SUMZA(1) / M
DO 70 J = 1, N
... SUMYY = SUMYY + (H(J) - EE(1)) ** 2)
70 CONTINUE
N = 10
... EEE(1) = SUMYY / ((N-1)*N)
80 CONTINUE
SUMV = SUMV + SUMYY
RMEAN = RMEAN + EE(1)
SSE = EEE(1)

```

ศูนย์วิทยทรัพยากร
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

```

100 CONTINUE
   WRITE(6,*) 'MEAN'
   RMEANL = RMEAN / 4979
   WRITE(6,*) RMEANL
   MSB = SSE / 4979
   WRITE(6,19) MSB
19 FORMAT('MSB = ',P20.10)
   STOP
   END

```

```

C-----C
C                               FUNCTION  RANDOM                               C
C-----C

```

```

FUNCTION RAND (IX)
  IX = IX * 16807
  IF (IX.LT.0.) IX = IX + 2147483647+1
  RAND = IX
  RAND = RAND * (0.465661E-9)
  RETURN
END

```

```

C-----C
C                               NORMAL  DISTRIBUTION                               C
C-----C

```

```

SUBROUTINE NORM(ME,VA,EX)
  COMMON/SEED/IX, KK
  SD = SQRT(VA)
  PI = 3.1415926
  IF (KK.EQ.1) GO TO 10
  RONE = RAND(IX)
  RTWO = RAND(IX)

```

ศูนย์วิทยทรัพยากร
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

```

ZONE = SQRT(-2*ALOG(RONE))*COS(2*PI*RTWO)
ZTWO = SQRT(-2*ALOG(RONE))*SIN(2*PI*RTWO)
EX = ZONE*SD + ME
KK = 1
GOTO 15
10 EX = ZTWO*SD + ME
KK = 0
15 RETURN
END

```

```

C-----C
C          CHI-SQUARE  DISTRIBUTION          C
C-----C

```

```

SUBROUTINE CHISQ( DF,CH1)
COMMON/SEED/IX, KK
CON1 = FLOAT(1)/SQRT( DF-1 )
CON2 = DF/2 - ALOG( 4 )
CON3 = DF/2 + 1/CON1
CON4 = 1 + ALOG( 4.5 )
1 U1 = RAND(IX)
U2 = RAND(IX)
CH11 = CON1*ALOG(U1/(1 - U1))
CH12 = ( DF/2 )*EXP( CH11 )
CH13 = ( U1**2 )*U2
CH14 = CON2 + CON3*CH11 - CH12
IF ( ( CH14 + CON4 - 4.5*CH13 ).GE.0 ) THEN
    CH1 = 2*CH12
ELSE IF( CH14.GE.ALOG(CH13)) THEN
    CH1 = 2*CH12
ELSE
    GOTO 1
END IF
RETURN
END

```

ศูนย์วิทยทรัพยากร
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

2) วิธีประมาณอันดับที่สอง (ตัวประมาณ EBLUE)

โปรแกรมที่ใช้ในการดำเนินการวิจัย มีรายละเอียดดังนี้

```

C-----C
C                MAIN PROGRAM                C
C-----C

      DIMENSION VAR (300),AVAR(300),MEAN(300),AMEAN(300),ERROR(300),
      *A(300),Y(300),YYY(300)
      REAL MEAN,MSE,RMEANL
      COMMON/SEED/IX, KK,N
      IX = 2601
      KK = 0

C-----C
C      BETA = 2,3,4,5,6 ; NUMBER OF TREATMENT(M) = 3,5,7,9,25,30,35 ; T = 0.5,1.0,1.5
C-----C

      BETA = 5
      M = 30
      RMEAN = 0.0
      SSE = 0.0

C-----C
C                KLEFFE AND RAO'S METHOD      C
C-----C

      DO 100 I,KLM = 1,4979
      SUMY = 0.0
      YY = 0.0
      N = 3
      DO 80 I = 1 ,M
      SUMY = 0.0
      DF = BETA
      CALL CHISQ( DF,CHI)
      VAR(I) = CHI
      ME = 1.
      VA = 1.
      CALL NORM( ME,VA,BX)
      MEAN(I) = EX
      DF = N - 1
      CALL CHISQ( DF,CHI)
      A(I) = CHI
      AVAR(I) = ( A(I)*VAR(I)) / DF

```



```

DO 50 K=1,N
  MB = 0.
  VA = AVAR(1)
  CALL NORM( MB,VA,EX )
  ERROR( K ) = EX
  Y( K ) = MEAN(1) + ERROR( K )
  SUMY = SUMY + Y( K )
50 CONTINUE
  SUMV = SUMV + AVAR(1)
  YYY(1) = SUMY / N
  YY = YY + YYY(1) / M
  N = 10
80 CONTINUE
  ABETA = -SUMV / M
  DO 90 J = 1, M
    SUMYY = SUMYY + (YYY(J) - YY) ** 2
  90 CONTINUE
C-----C
C      AC = ABETA / 3 * ADELTA      C
C      WHILE N(1) = 3 , AC = ABETA / 3 * ADELTA      C
C      AC = ABETA / 10 * ADELTA      C
C      WHILE N(1) = 10 , AC = ABETA / 10 * ADELTA      C
C-----C
  ADELTA = SUMYY / (M - 1)
  AC = ABETA / ( 3 * ADELTA )
C-----C
C      CALCULATING MEAN OF EBLUE      C
C-----C
  AMEAN(1) = YYY(1) - AC * ( YYY(1) - YY )
  RMBAN = RMEAN + AMEAN(1)
  SSE = SSE + ( AMEAN(1) - MEAN(1) ) ** 2
100 CONTINUE

```

```

WRITE(6,*) 'MEAN'
RMEANL = RMEAN / 4979
WRITE(6,*) RMEANL
MSE = SSE/4979
WRITE(6,19) MSE
19 FORMAT(' MSE OF EBLUB = ',F20.10)
STOP
END

```

```

C-----C
C          FUNCTION_RANDOM
C-----C

```

```

FUNCTION_RANDOM (IX)
IX = IX*16807
IF (IX.LT.0) IX = -IX + 2147483647 + 1
RAND = IX
RAND = RAND*(0.465661E-9)
RETURN
END

```

```

C-----C
C          NORMAL_DISTRIBUTION
C-----C

```

```

SUBROUTINE NORM(ME,VA,EX)
COMMON/SEED/IX, KK
SD = SQRT(VA)
PI = 3.14159265
IF (KK.EQ.1) GO TO 10
RONE = RAND(IX)
RTWO = RAND(IX)
ZONE = SQRT(-2*ALOG(RONE))*COS(2*PI*RTWO)
ZTWO = SQRT(-2*ALOG(RONE))*SIN(2*PI*RTWO)
EX = ZONE*SD + ME
KK = 1
GO TO 15
10 EX = ZTWO*SD + ME
KK = 0
15 RETURN
END

```

คู่มือวิทยานิพนธ์
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

```

C-----C
C          ~CHI-SQUARE DISTRIBUTION          C
C-----C

SUBROUTINE CHISQ( DF,CHI)
COMMON/SESD/DX, KK
CON1 = FLOAT( 1 )/SQRT( DF - 1 )
CON2 = DF/2 - ALOG( 4 )
CON3 = DF/2 + 1/CON1
CON4 = 1 +ALOG( 4.5 )
1 U1 = RAND(DX)
  U2 = RAND(DX)
  CH11 = CON1*ALOG(U1/(1 - U1))
  CH12 = ( DF/2 )*EXP(-CH11 )
  CH13 = ( U1**2 )*U2
  CH14 = CON2+CON3*CH11 -CH12
  IF ((CH14+CON4 - 4.5*CH13).GE.0) THEN
    CH1 = 2*CH12
  ELSE IF(CH14.GE.ALLOG(CH13)) THEN
    CH1 = 2*CH12
  ELSE
    GOTO 1
  END IF
RETURN
END

```

ศูนย์วิทยทรัพยากร
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

3). วิธีประมาณอันดับที่สอง (ตัวประมาณอย่างง่าย (NAIVE ESTIMATOR))
โปรแกรมที่ใช้ในการดำเนินการวิจัย มีรายละเอียดดังนี้

```

C-----C
C           MAIN PROGRAM           C
C-----C

      DIMENSION VAR (300),AVAR(300),MEAN(300),ERROR(300),A (300),Y(300),
*YYY(300)
      REAL MBAN,MSB
      COMMON/SEED/IX,KK,N
      IX = 2601
      KK = 0

C-----C
C      BETA= 2,3,4,5,6 ; NUMBER OF TREATMENT (M) = 3,5,7,9,25,30,35 ; T=0.5, 1.0 ,1.5
C-----C

      BETA = 5
      M = 30
      SSE = 0.0

C-----C
C      KLEFFER AND RAO'S METHOD ( NAIVE ESTIMATOR ) C
C-----C

      DO 100 UKLM = 1,4979
      SUMYY = 0.0
      SUMV = 0.0
      YY = 0.0
      N = 3
      DO 80 I = 1 ,M
      SUMY = 0.0
      DF = BETA
      CALL CHISQ( DF,CHI)
      VAR(I) = CHI
      MB = 1.
      YA = 1.
      CALL NORM( MB,VA,EX)

```

```

- MBAN(1) = EX
- DF = N - 1
CALL CHSQ( DF, CHI )
A(1) = CHI
AVAR(1) = ( A(1)*VAR(1) ) / DF
DO 50 K=1,N
ME = 0.
VA = AVAR(1)
CALL NORM( ME,VA,EX )
ERROR( K ) = EX
Y( K ) = MEAN(1) + ERROR( K )
SUMY = SUMY + Y( K )
50 CONTINUE
SUMV = SUMV + AVAR(1)
YY(1) = SUMY / N
YY = YY + YY(1) / M
N = 10
80 CONTINUE
ABETA = SUMV / M
DO 90 J = 1, M
SUMYY = SUMYY + ( YY(J) - YY ) ** 2
90 CONTINUE
C-----C
C      C =  $\beta / N(1) * DELTA$  C
C      WHILE  $\beta = ABETA$  , N(1) = 3 OR 10 , DELTA = ADELTA C
C      AC = ABETA / N(1) * ADELTA C
C      VAR( MEAN( 1 ) ) = AD = ABS ( ADELTA - ABETA / N(1) ) C
C-----C
- ADELTA = SUMYY / ( M - 1 )
AC = ABETA / ( 3 * ADELTA )
AD = ABS( ADELTA - ABETA / 3 )
SSE = SSE + ( AC * ( AD + ABETA / ( M * 3 ) ) )

```

ศูนย์วิทยุพัชกร
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

```

100 CONTINUE
      MSE = SSE/4979
      WRITE(6,19) MSE
19  FORMAT(' RMSB = ',F20.10)
      STOP
      END

```

```

C-----C
C              FUNCTION  RANDOM              C
C-----C

```

```

FUNCTION RAND (IX)
  IX = IX*16807
  IF (IX.LT.0) IX = IX + 2147483647+1
  RAND = IX
  RAND = RAND*(0.465661E-9)
  RETURN
END

```

```

C-----C
C              NORMAL  DISTRIBUTION          C
C-----C

```

```

SUBROUTINE NORM( ME,VA,EX )
  COMMON/SEED/IX, KK
  SD = SQRT(VA)
  PI = 3.1415926
  IF ( KK.EQ.1 ) GO TO 10
  RONE = RAND( IX )
  RTWO = RAND( IX )
  ZONE = SQRT(-2*ALOG( RONE ))*COS( 2*PI*RTWO )
  ZTWO = SQRT(-2*ALOG( RONE ))*SIN( 2*PI*RTWO )
  EX = ZONE*SD + ME
  KK = 1
  GOTO 15
10 EX = ZTWO*SD + ME
  KK = 0
15 RETURN
END

```

ศูนย์วิจัยทรัพยากร
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

```

C-----C
C          CHI-SQUARE DISTRIBUTION          C
C-----C

SUBROUTINE CHISQ( DF,CHI )
COMMON/SEED/IX,KK
CON1 = FLOAT( 1 )/SQRT( DF - 1 )
CON2 = DF/2 * ALOG( 4. )
CON3 = DF/2 + 1/CON1
CON4 = 1 +ALOG( 4.5 )
1 U1 = RAND(IX)
  U2 = RAND(IX)
  CH1 = CON1*ALOG(U1/(1 - U1))
  CH2 = ( DF/2 )*EXP( CH1 )
  CH3 = ( U1**2 )*U2
  CH4 = CON2 + CON3*CH1 -CH2
  IF((CH4+CON4-.45*CH3).GE.0) THEN
    CHI = 2*CH2
  ELSE IF(CH4.GE.AL0G(CH3)) THEN
    CHI = 2*CH2
  ELSE
    GO TO 1
  END IF
RETURN
END

```

ศูนย์วิทยทรัพยากร
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

4). วิธีปรับปรุงจากวิธีของเคลฟี่และราว

โปรแกรมที่ใช้ในการดำเนินการวิจัย มีรายละเอียดดังต่อไปนี้

```

C-----C
C          MAIN PROGRAM          C
C-----C
C   DIMENSION VAR(300),AVAR(300),MEAN(300),ABAR(300),ERROR(300),
C   *A(300),Y(300),YYY(300),SUMB(300)
C   REAL MBAN,MSB,RBARL
C   COMMON/SEED/IX,KK,N
C   IX = 2601
C   KK = 0
C-----C
C   BETA = 2,3,4,5,6 ; NUMBER OF TREATMENT (M) = 3,5,7,9,25,30,35 ; T = 0.5,1.0,1.5
C-----C
C   BETA = 5
C   M = 30
C   RBAR = 0.0
C   SSB = 0.0
C-----C
C   ADAPTIVE KLEFFER AND RAO'S METHOD
C   UNDER THE ASSUMPTION OF EQUALLY ERROR VARIANCE
C   SIGMA = BETA SUM SQUARE WITHIN GROUP
C-----C
C   DO 100 UKLM = 1,4979
C   YY = 0.0
C   N = 3
C   DO 80 I = 1,M
C   SUMY = 0.0
C   DF = BETA
C   CALL CHISQ( DF,CHI)
C   VAR(I) = CHI

```



```

- ME = 1.
  VA = 1.
  CALL NORM(MB,VA,EX)
  MEAN(1) = EX
  DF = N - 1
  CALL CHISQ(DF,CHI)
  A(1) = CHI
  AVAR(1) = (A(1)*VAR(1))/DF
  DO 50 K=1,N
  ME = 0.
  VA = AVAR(1)
  CALL NORM(MB,VA,EX)
  ERROR(K) = EX
  Y(K) = MEAN(1) + ERROR(K)
  SUMY = SUMY + Y(K)
50 CONTINUE
  YYY(1) = SUMY / N
  SB = 0.0
  DO 60 K = 1, N
  SB = SB + ((Y(K) - YYY(1))**2)
60 CONTINUE
  YY = YY + YYY(1) / M
  SUMB(1) = SB / (N - 1)
  N = 10
80 CONTINUE
  BB = SUMB(1)
  DO 90 J = 1, M
  SUMYY = SUMYY + (YY(J) - YY)**2
90 CONTINUE
C-----C
C      C =  $\beta / N(1) * DELTA$  C
C      WHILE  $\beta = \text{SUM SQUARE WITHIN GROUP}(1)$  C
C      N(1) = 3 OR 10 , DELTA = ADELTA, C
C      ACC = BB / (N(1) * ADELTA) C
C      VAR(MEAN(1)) = ABS(ADELTA - BB/3) C
C      WHILE N(1) = 10 , ACC = BB / (10 * ADELTA) C
C      VAR(MEAN(1)) = ABS(ADELTA - BB/10) C
C-----C

```

```

ADELTA = SUMYY/(M - 1)
ACC = BB / ( 3* ADELTA )
AE = ABS ( ADELTA - BB/3 )

```

```

-----C
C   CALCULATING MEAN SQUARE ERROR   FOR  ITH TREATMENT C
-----C

```

```

ABAR(1) = YYY(1) - ACC*( YYY(1) - YY )
RBAR = RBAR + ABAR(1)
SSE = SSE + (ACC *(AE+BB/(M *10)))

```

```
100 CONTINUE
```

```
WRITE( 6,* ) 'MEAN'
```

```
RBARL = RBAR / 4979
```

```
WRITE( 6,* ) RBARL
```

```
MSE = SSE/4979
```

```
WRITE( 6,19 ) MSE
```

```
19 FORMAT( 'RMSE = ',F20.10 )
```

```
STOP
```

```
END
```

```

-----C
C   FUNCTION   RANDOM   C
-----C

```

```
FUNCTION RAND (IX)
```

```
IX = IX*16807
```

```
IF (IX.LT.0) IX = IX + 2147483647+1
```

```
RAND = IX
```

```
RAND = RAND*(0.465661E-9)
```

```
RETURN
```

```
END
```

```

-----C
C   NORMAL   DISTRIBUTION   C
-----C

```

```
-----SUBROUTINE-NORM(ME,VA,EX)
```

```
-----COMMON/SEED/IX, KK
```

```
SD = SQRT(VA)
```

```
PI = 3.1415926
```

```

IF ( KK.EQ.1 ) GO TO 10
RONE = RAND( IX )
RTWO = RAND( IX )
ZONE = SQRT( -2*ALOG( RONE ) ) * COS( 2*PI*RTWO )
ZTWO = SQRT( -2*ALOG( RONE ) ) * SIN( 2*PI*RTWO )
EX = ZONE*SD + ME
KK = 1
GOTO 15
10 EX = ZTWO*SD + ME
KK = 0
15 RETURN
END

```

```

C-----C
C          CHI-SQUARE DISTRIBUTION          C
C-----C

```

```

SUBROUTINE CHISQ( DF,CHI )
COMMON/SEED/IX, KK
CON1 = FLOAT( 1 ) / SQRT( DF - 1 )
CON2 = DF/2 - ALOG( 4 )
CON3 = DF/2 + 1/CON1
CON4 = 1 + ALOG( 4.5 )
1 U1 = RAND( IX )
U2 = RAND( IX )
CH11 = CON1 * ALOG( U1 / ( 1 - U1 ) )
CH12 = ( DF/2 ) * EXP( CH11 )
CH13 = ( U1 ** 2 ) * U2
CH14 = CON2 + CON3 * CH11 - CH12
IF ( ( CH14 + CON4 - 4.5 * CH13 ) .GE. 0 ) THEN
    CHI = 2 * CH12
ELSE IF ( CH14 .GE. ALOG( CH13 ) ) THEN
    CHI = 2 * CH12
ELSE
    GOTO 1
END IF
RETURN
END

```

ศูนย์วิทยุทัพยากร
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

ประวัติผู้เขียน

นางสาวนุชรี วีรพจน์ เกิดเมื่อวันที่ 31 มีนาคม พ.ศ. 2511 ที่จังหวัดนครราชสีมา สำเร็จการศึกษาปริญญาวิทยาศาสตรบัณฑิต สาขาสถิติ จากคณะวิทยาศาสตร์และเทคโนโลยี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์และการเมือง ปีการศึกษา 2533 ได้เข้าศึกษาต่อในหลักสูตรสถิติศาสตรมหาบัณฑิต ที่จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย เมื่อปีการศึกษา 2536



ศูนย์วิทยทรัพยากร
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย