

วิธีการประมาณค่าพารามิเตอร์สำหรับแผนกราฟทดลองจัตุรัสลดตินที่มีอิทธิพลปัจจัยคงที่  
ด้วยข้อมูลระยะยาว



นายประยุ๊ด แสงงาม

# ศูนย์วิทยทรัพยากร จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

วิทยานิพนธ์เป็นส่วนหนึ่งของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญาโทดิศิตศาสตรมหาบัณฑิต

สาขาวิชาสถิติ ภาควิชาสถิติ

คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

ปีการศึกษา 2547

ISBN 974-17-6785-4

ลิขสิทธิ์ของจุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

PARAMETER ESTIMATION METHODS FOR FIXED-EFFECT LATIN SQUARE  
DESIGN WITH LONGITUDINAL DATA

Mr. Prayad Sangngam

ศูนย์วิทยทรัพยากร  
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย  
A Thesis Submitted in Partial Fulfillment of the Requirements  
for the Degree of Master of Science in Statistics

Department of Statistics

Faculty of Commerce and Accountancy

Chulalongkorn University

Academic Year 2004

ISBN 974-17-6785-4

หัวข้อวิทยานิพนธ์ วิธีการประมาณค่าพารามิเตอร์สำหรับแผนกราฟทดลองจัตุรัสสละตินที่มีอิทธิพลปัจจัยคงที่ ด้วยข้อมูลระยะยาวยา  
โดย นายประษะด แสงงาม  
สาขาวิชา สถิติ  
อาจารย์ที่ปรึกษา รองศาสตราจารย์ ดร.สุพล ดุรงค์วัฒนา

---

คณะกรรมการบัญชี จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย อนุมัติให้นับวิทยานิพนธ์  
ฉบับนี้เป็นส่วนหนึ่งของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญามหาบัณฑิต

..... ๑๗ ๑๘๘๒๔๖๙ ..... คณบดีคณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี  
(ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.ดนุชา คุณพนิกกิจ)

คณะกรรมการสอบวิทยานิพนธ์

..... ๒๕ ๒๖๒๓ ..... ประธานกรรมการ  
(รองศาสตราจารย์ ดร. มีระพร วีระถาวร)

..... อาจารย์ที่ปรึกษา  
(รองศาสตราจารย์ ดร.สุพล ดุรงค์วัฒนา)

..... กรรมการ  
(อาจารย์ ดร. เอกสาร เกียรติสุไพบูลย์)

ประชยด แสงงาม : วิธีการประมาณค่าพารามิเตอร์สำหรับแผนกราฟทดลองจัตุรัสลดตินที่มีอิทธิพลปัจจัยคงที่ ด้วยข้อมูลระยะยา (PARAMETER ESTIMATION METHODS FOR FIX-EFFECT LATIN SQUARE DESIGN WITH LONGITUDINAL DATA) อ.ที่ปรึกษา : วศ.ดร.สุพล ดุรงค์วัฒนา, 120 หน้า.  
ISBN 974-17-6785-4

การวิจัยครั้งนี้มีวัตถุประสงค์ เพื่อเปรียบเทียบวิธีการประมาณค่าพารามิเตอร์ในแผนแบบกราฟทดลองจัตุรัสลดตินที่มีอิทธิพลปัจจัยคงที่ เมื่อทำการเก็บข้อมูลระยะยา และความคลาดเคลื่อนมีความสัมพันธ์กันในรูปแบบ อัตตสัมพันธ์อันดับที่หนึ่ง (First Order Autoregressive Model (AR1)) 2 วิธี คือ วิธีความ praw เป็นสูงสุด (Maximum Likelihood Method (MLE)) และวิธีการประมาณแบบสองขั้น (Two-Stage Method (TS)) เปรียบเทียบภายใต้เงื่อนไข ข้อมูลแต่ละหน่วยทดลอง มีการแจกแจงแบบปกติหลายตัวแปร (Multivariate Normal Distribution) ที่เวกเตอร์ค่าเฉลี่ย  $\mu$  เมทริกซ์ความแปรปรวนร่วม  $V_h$  กำหนดอัตตสัมพันธ์เป็น  $\pm 0.1 \pm 0.2$   
 $\sim_h$   
 $\pm 0.3 \pm 0.4 \pm 0.5 \pm 0.6 \pm 0.7 \pm 0.8$  และ  $\pm 0.9$  สัมประสิทธิ์ความผันแปร 10% 20% และ 30% ระยะเวลาการเก็บข้อมูล 3 4 6 และ 9 ขนาดของแผนกราฟทดลอง  $3 \times 3$   $4 \times 4$  และ  $5 \times 5$  ข้อมูลที่ใช้ในการวิจัยได้จากการจำลองข้อมูลด้วยเทคนิคคอมพิวเตอร์โดยโปรแกรม S-PLUS 2000 ทำการทดลองขั้นๆ กัน 500 ครั้งในแต่ละสถานการณ์ที่กำหนด ทำการเปรียบเทียบวิธีการประมาณค่าพารามิเตอร์ โดยพิจารณาจากค่ารากที่สองของความคลาดเคลื่อนกำลังสองเฉลี่ย (Root Mean Squares Error) โดยวิธีได้ให้ค่าน้อยกว่าแสดงว่าเหมาะสมกับการประมาณค่าพารามิเตอร์

### ผลการวิจัยสรุปได้ดังนี้

วิธีความ praw เป็นสูงสุดเหมาะสมกับการประมาณค่าพารามิเตอร์มากกว่าวิธีการประมาณแบบสองขั้น ในทุก ๆ สถานการณ์ที่กำหนด โดยความผิดพลาดในการประมาณค่าพารามิเตอร์จะแตกต่างกันมากขึ้น เมื่อค่าสัมบูรณ์ของสัมประสิทธิ์อัตตสัมพันธ์มีค่าเพิ่มขึ้น ปัจจัยอื่นที่มีผลต่อการประมาณค่าพารามิเตอร์ คือ ขนาดของแผนกราฟทดลอง ระยะเวลาการเก็บข้อมูลขั้น และ สัมประสิทธิ์ความผันแปร กล่าวคือ

1. ความผิดพลาดในการประมาณค่าจะแปรผันกับขนาดของแผนกราฟทดลอง คือ เมื่อขนาดของแผนกราฟทดลองใหญ่ขึ้น ทำให้ความผิดพลาดในการประมาณค่าลดลง
2. ความผิดพลาดในการประมาณค่าจะแปรผันกับระยะเวลาการเก็บข้อมูลขั้น คือ เมื่อระยะเวลาการเก็บข้อมูลขั้นเพิ่มมากขึ้น ทำให้ความผิดพลาดในการประมาณค่าลดลง
3. ความผิดพลาดในการประมาณค่าจะแปรผันตรงกับสัมประสิทธิ์ความผันแปร คือ เมื่อสัมประสิทธิ์ความผันแปรเพิ่มขึ้น ทำให้ความผิดพลาดในการประมาณค่าเพิ่มขึ้น

ภาควิชา..... สาขาวิชา..... ปีการศึกษา..... สถิตि..... ลายมือชื่อนิสิต.....  
 สาขาวิชา..... สาขาวิชา..... ลายมือชื่ออาจารย์ที่ปรึกษา.....  
 2547..... 

## 4582280426 : MAJOR STATISTICS

KEY WORD: LONGITUDINAL DATA / AUTOREGRESSIVE / MAXIMUM LIKELIHOOD / TWO-STAGE

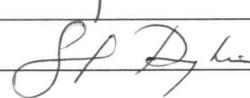
PRAYAD SANGNGAM: PARAMETER ESTIMATION METHODS FOR FIX-EFFECT LATIN SQUARE DESIGN WITH LONGITUDINAL DATA. THESIS ADVISOR: ASSOC. PROF. SUPOL DURONGWATTANA Ph.D. 120 pp. ISBN 974-17-6785-4

The objective of this research is to compare the value of the parameter estimation in a fixed-effect Latin square design with longitudinal data when errors follow a first-order autoregressive model: AR(1), with the maximum likelihood method : MLE, and Two-Stage estimation method : TS. The comparison is under the term of observation data of subject having multivariate normal distribution with mean vector  $\mu$ , covariance matrix  $V_h$ . The autoregressive relations are  $\pm 0.1, \pm 0.2, \pm 0.3, \pm 0.4, \pm 0.5, \pm 0.6, \pm 0.7, \pm 0.8$  and  $\pm 0.9$ . The coefficients of variance are 10%, 20% and 30%. The periods of replication are 3, 4, 6 and 9. The sizes of experimental design are 3x3, 4x4 and 5x5. The data are derived from simulation by Monte Carlo technique with S- Plus program and repeated 500 times for each situation. The parameter estimation method is compared by considering root mean squares error: RMSE, the method with less assessment value than the other shows suitability for parameter estimation.

The conclusions of this research are as follow:

The maximum likelihood method is more suitable than the two-stage method in all situations. The root mean squares error is more different when the absolute value of autoregressive increases. The other factors with affect parameter estimations are size of experimental design, period of replication and coefficient of variance, namely:

1. The error for estimation will inverse by size of experimental design which means that when the size of experimental design is larger, the error for estimation will decrease.
2. The error for estimation will inverse by periods of replication with means that when the periods of replication are more, the error for estimation will decrease.
3. The error for estimation will inverse directly with the coefficient of variance which means that when the coefficients of variance are more, the error for estimation will increase.

Department	Statistics	Student's signature	
Field of study	Statistics	Advisor's signature	
Academic year	2004		

## กิตติกรรมประกาศ

วิทยานิพนธ์ฉบับนี้สำเร็จลุล่วงไปด้วยความช่วยเหลืออย่างดียิ่งของ รองศาสตราจารย์ ดร.สุพล ดุรงค์วัฒนา อาจารย์ที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์ ที่กรุณายieldให้คำแนะนำตลอดจนช่วยเหลือแก่ไขข้อบกพร่องต่าง ๆ ด้วยดีตลอดมา รองศาสตราจารย์ ดร.ธีระพร วีระถาวร ประธานสอบวิทยานิพนธ์ อาจารย์ ดร.เสกสรร เกียรติสุพูรลย์ กรรมการสอบวิทยานิพนธ์ ที่กรุณายieldให้คำแนะนำช่วยเหลือด้านทฤษฎีทางสถิติ ทฤษฎีการจำลอง และตรวจสอบแก้ไขจนวิทยานิพนธ์นี้เสร็จสมบูรณ์ยิ่งขึ้น จึงคร่าวข้อขอบพระคุณเป็นอย่างสูงมา ณ โอกาสนี้

ท้ายนี้ ผู้วิจัยคร่าวข้อขอบคุณ บิดา มารดา พี่ ที่ส่งเสริมและสนับสนุนด้านการเรียนของผู้วิจัยและเป็นกำลังใจให้เสมอมา และขอบคุณเพื่อน ๆ ที่ให้กำลังใจแก่ผู้วิจัย

**ศูนย์วิทยทรัพยากร  
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย**

## สารบัญ

	หน้า
บทคัดย่อภาษาไทย.....	๑
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ.....	๑
กิตติกรรมประกาศ.....	๖
สารบัญ.....	๗
สารบัญตาราง.....	๘
สารบัญรูป.....	๙
 บทที่ 1 บทนำ.....	 1
1.1 ความเป็นมาและความสำคัญของปัญหา.....	1
1.2 วัตถุประสงค์ของการวิจัย.....	3
1.3 สมมติฐานของการวิจัย.....	3
1.4 ข้อตกลงเบื้องต้น .....	3
1.5 ขอบเขตของการวิจัย.....	5
1.6 เกณฑ์ในการตัดสินใจ.....	6
1.7 คำจำกัดความที่ใช้ในการวิจัย.....	6
1.8 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับ.....	6
1.9 สัญลักษณ์ในการวิจัย.....	7
 บทที่ 2 ข้อมูลและทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง.....	 8
2.1 ตัวแบบที่ทำการศึกษา.....	8
2.2 คุณสมบัติของความคลาดเคลื่อน.....	9
2.2.1 ค่าคาดหมายของความคลาดเคลื่อน.....	10
2.2.2 ความแปรปรวนของความคลาดเคลื่อน.....	10
2.2.3 ความแปรปรวนร่วมของความคลาดเคลื่อน.....	11
2.2.4 การหาอินเวอร์ซของเมทริกซ์.....	14
2.3 วิธีการประมาณค่าพารามิเตอร์.....	15
2.3.1 วิธีความควรจะเป็นสูงสุด.....	15
2.3.2 วิธีการประมาณแบบสองขั้น.....	26

## สารบัญ (ต่อ)

	หน้า
<b>บทที่ 3 วิธีดำเนินการวิจัย.....</b>	31
3.1 การกำหนดค่าพารามิเตอร์.....	31
3.2 การจำลองข้อมูลที่มีการแจกแจงแบบปกติหลายตัวแปร.....	36
3.3 การประมาณค่าพารามิเตอร์.....	37
3.3.1 วิธีการประมาณแบบสองขั้น.....	38
3.3.2 วิธีความควรจะเป็นสูงสุด.....	39
3.4 การเปรียบเทียบวิธีการประมาณค่าพารามิเตอร์.....	40
3.5 ขั้นตอนการดำเนินงานของโปรแกรม.....	41
 <b>บทที่ 4 ผลการวิจัย.....</b>	 46
4.1 ผลการเปรียบเทียบเมื่อสัมประสิทธิ์อัตตสหสมพันธ์มีทิศทางเดียวกัน.....	47
4.2 ผลการเปรียบเทียบเมื่อสัมประสิทธิ์อัตตสหสมพันธ์มีทิศทางตรงข้าม.....	73
 <b>บทที่ 5 สรุปผลการวิจัยและข้อเสนอแนะ.....</b>	 98
5.1 สรุปผลการวิจัย.....	98
5.2 ปัจจัยที่ส่งผลต่อการประมาณค่าพารามิเตอร์.....	99
5.3 ข้อเสนอแนะ.....	101
 <b>รายการอ้างอิง.....</b>	 102
 <b>ภาคผนวก.....</b>	 103
ภาคผนวก ก.....	104
ภาคผนวก ข.....	108
<b>ประวัติผู้เขียนวิทยานิพนธ์.....</b>	120

## สารบัญตาราง

๘

ตาราง	หน้า
4.1.1 เปรียบเทียบค่า ragazziที่สองของความคลาดเคลื่อนกำลังสองเฉลี่ยวิธีความเคราะห์เป็นสูงสุดและวิธีการประมาณแบบสองขั้น ในแผนแบบการทดลองขนาด $3 \times 3$ จัตุรัสลดติน กรณี เก็บข้อมูลชั้น 3 และ 4 ระยะเวลา เมื่ออัตตสหสมพันธ์มีทิศทางเดียวกัน.....	50
4.1.2 เปรียบเทียบค่า ragazziที่สองของความคลาดเคลื่อนกำลังสองเฉลี่ยวิธีความเคราะห์เป็นสูงสุดและวิธีการประมาณแบบสองขั้น ในแผนแบบการทดลองขนาด $3 \times 3$ จัตุรัสลดติน กรณี เก็บข้อมูลชั้น 6 และ 9 ระยะเวลา เมื่ออัตตสหสมพันธ์มีทิศทางเดียวกัน.....	51
4.1.3 เปรียบเทียบค่า ragazziที่สองของความคลาดเคลื่อนกำลังสองเฉลี่ยวิธีความเคราะห์เป็นสูงสุดและวิธีการประมาณแบบสองขั้น ในแผนแบบการทดลองขนาด $4 \times 4$ จัตุรัสลดติน กรณี เก็บข้อมูลชั้น 3 และ 4 ระยะเวลา เมื่ออัตตสหสมพันธ์มีทิศทางเดียวกัน.....	57
4.1.4 เปรียบเทียบค่า ragazziที่สองของความคลาดเคลื่อนกำลังสองเฉลี่ยวิธีความเคราะห์เป็นสูงสุดและวิธีการประมาณแบบสองขั้น ในแผนแบบการทดลองขนาด $4 \times 4$ จัตุรัสลดติน กรณี เก็บข้อมูลชั้น 6 และ 9 ระยะเวลา เมื่ออัตตสหสมพันธ์มีทิศทางเดียวกัน.....	58
4.1.5 เปรียบเทียบค่า ragazziที่สองของความคลาดเคลื่อนกำลังสองเฉลี่ยวิธีความเคราะห์เป็นสูงสุดและวิธีการประมาณแบบสองขั้น ในแผนแบบการทดลองขนาด $5 \times 5$ จัตุรัสลดติน กรณี เก็บข้อมูลชั้น 3 และ 4 ระยะเวลา เมื่ออัตตสหสมพันธ์มีทิศทางเดียวกัน.....	64
4.1.6 เปรียบเทียบค่า ragazziที่สองของความคลาดเคลื่อนกำลังสองเฉลี่ยวิธีความเคราะห์เป็นสูงสุดและวิธีการประมาณแบบสองขั้น ในแผนแบบการทดลองขนาด $5 \times 5$ จัตุรัสลดติน กรณี เก็บข้อมูลชั้น 6 และ 9 ระยะเวลา เมื่ออัตตสหสมพันธ์มีทิศทางเดียวกัน.....	65
4.1.7 การทดสอบสมมติฐานปัจจัยที่มีผลต่อค่า ragazziที่สองของความคลาดเคลื่อน กำลังสองเฉลี่ยกรณีสัมประสิทธิ์อัตตสหสมพันธ์มีทิศทางเดียวกัน.....	71

ตาราง	หน้า
4.2.1 เปรียบเทียบค่ารากที่สองของความคลาดเคลื่อนกำลังสองเฉลี่ยวิธีความควรจะเป็นสูงสุดและวิธีการประมาณแบบสองขั้น ในแผนแบบการทดลองขนาด 3x3 จัตุรัสลําติน กรณีเก็บข้อมูลชั้น 3 และ 4 ระยะเวลา เมื่ออัตโนมัติพันธ์มีทิศทางตรงข้าม.....	75
4.2.2 เปรียบเทียบค่ารากที่สองของความคลาดเคลื่อนกำลังสองเฉลี่ยวิธีความควรจะเป็นสูงสุดและวิธีการประมาณแบบสองขั้น ในแผนแบบการทดลองขนาด 3x3 จัตุรัสลําติน กรณีเก็บข้อมูลชั้น 6 และ 9 ระยะเวลา เมื่ออัตโนมัติพันธ์มีทิศทางตรงข้าม.....	76
4.2.3 เปรียบเทียบค่ารากที่สองของความคลาดเคลื่อนกำลังสองเฉลี่ยวิธีความควรจะเป็นสูงสุดและวิธีการประมาณแบบสองขั้น ในแผนแบบการทดลองขนาด 4x4 จัตุรัสลําติน กรณีเก็บข้อมูลชั้น 3 และ 4 ระยะเวลา เมื่ออัตโนมัติพันธ์มีทิศทางตรงข้าม.....	82
4.2.4 เปรียบเทียบค่ารากที่สองของความคลาดเคลื่อนกำลังสองเฉลี่ยวิธีความควรจะเป็นสูงสุดและวิธีการประมาณแบบสองขั้น ในแผนแบบการทดลองขนาด 4x4 จัตุรัสลําติน กรณีเก็บข้อมูลชั้น 6 และ 9 ระยะเวลา เมื่ออัตโนมัติพันธ์มีทิศทางตรงข้าม.....	83
4.2.5 เปรียบเทียบค่ารากที่สองของความคลาดเคลื่อนกำลังสองเฉลี่ยวิธีความควรจะเป็นสูงสุดและวิธีการประมาณแบบสองขั้น ในแผนแบบการทดลองขนาด 5x5 จัตุรัสลําติน กรณีเก็บข้อมูลชั้น 3 และ 4 ระยะเวลา เมื่ออัตโนมัติพันธ์มีทิศทางตรงข้าม.....	89
4.2.6 เปรียบเทียบค่ารากที่สองของความคลาดเคลื่อนกำลังสองเฉลี่ยวิธีความควรจะเป็นสูงสุดและวิธีการประมาณแบบสองขั้น ในแผนแบบการทดลองขนาด 5x5 จัตุรัสลําติน กรณีเก็บข้อมูลชั้น 6 และ 9 ระยะเวลา เมื่ออัตโนมัติพันธ์มีทิศทางตรงข้าม.....	90
4.2.7 การทดสอบสมมติฐานปัจจัยที่มีผลต่อค่ารากที่สองของความคลาดเคลื่อน กำลังสองเฉลี่ยกรณีสัมประสิทธิ์อัตโนมัติพันธ์ทิศทางตรงข้าม.....	96







รูป	หน้า
4.2.10 ความสัมพันธ์ระหว่างค่ารากที่สองของความคลาดเคลื่อนกำลังสองเฉลี่ย และสัมประสิทธิ์ในตัวแบบอัตโนมัติ 5x5 ในแผนแบบการทดลองขนาด 5x5 จัตุรัสลดต้น กรณีเก็บข้อมูลชั้น 4 ระยะเวลา เมื่ออัตโนมัติ ทางตรงข้าม.....	92
4.2.11 ความสัมพันธ์ระหว่างค่ารากที่สองของความคลาดเคลื่อนกำลังสองเฉลี่ย และสัมประสิทธิ์ในตัวแบบอัตโนมัติ 5x5 จัตุรัสลดต้น กรณีเก็บข้อมูลชั้น 6 ระยะเวลา เมื่ออัตโนมัติ ทางตรงข้าม.....	93
4.2.12 ความสัมพันธ์ระหว่างค่ารากที่สองของความคลาดเคลื่อนกำลังสองเฉลี่ย และสัมประสิทธิ์ในตัวแบบอัตโนมัติ 5x5 จัตุรัสลดต้น กรณีเก็บข้อมูลชั้น 9 ระยะเวลา เมื่ออัตโนมัติ ทางตรงข้าม.....	94


  
**ศูนย์วิทยทรัพยากร**  
**จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย**