

สารบัญญัตราง

ตารางที่		หน้า
1	ค่าคอนทริสต์และสัมประสิทธิ์ของคอนทริสต์	24
2	สัญลักษณ์ที่ใช้แทนชื่อวิธีทำ	29
3	เวลาที่ใช้ในการดำเนินการพยากรณ์ด้วยตัวแบบ AR(5) เมื่อใช้วิธีกำลังสองน้อยสุด และวิธีของ Yule-Walker เพื่อพยากรณ์ไปข้างหน้าหนึ่งช่วงเวลาเพียงหนึ่งครั้ง.....	53
4	ค่าเศษส่วนเหลือที่ได้จากการพยากรณ์ด้วยตัวแบบ AR(5) เมื่อใช้วิธีกำลังสองน้อยสุด และวิธี ของ Yule-Walker เพื่อพยากรณ์ไปข้างหน้าหนึ่งช่วงเวลาเพียงหนึ่งครั้ง	56
5	เวลาที่ใช้ในการดำเนินการพยากรณ์ด้วยตัวแบบ AR(5) เมื่อใช้วิธีกำลังสองน้อยสุด วิธีของ Yule-Walker และวิธีกำลังสองน้อยสุดที่มีการถ่วงน้ำหนักเพื่อพยากรณ์ไปข้างหน้าทีละหนึ่งช่วงเวลา แต่พยากรณ์ติดต่อกันเป็นเวลานาน ...	60
6	ค่าสัมประสิทธิ์ของคอนทริสต์ในการตรวจความเท่ากันของค่าเวลาเฉลี่ยที่ใช้ในการดำเนินการ.....	61
7	การวิเคราะห์ความแปรปรวนแบบทางเดียวโดยใช้คอนทริสต์	61
8	เปรียบเทียบวิธีประมาณค่าพารามิเตอร์ของตัวแบบถดถอยบนตัวเองเมื่อพิจารณาเวลาที่ใช้ในการดำเนินการพยากรณ์.....	66
9	เวลาที่ใช้ในการดำเนินการพยากรณ์ข้อมูลราคาปิดของหุ้นบริษัทแห่งหนึ่งด้วยตัวแบบ AR(1) เมื่อใช้วิธีกำลังสองน้อยสุด และวิธี Yule-Walker เพื่อพยากรณ์ไปข้างหน้าทีละหนึ่งช่วงเวลา แต่พยากรณ์ติดต่อกันเป็นเวลานาน	67
10	ค่าเฉลี่ยของค่าเศษส่วนเหลือกำลังสองจากการพยากรณ์ด้วยตัวแบบ AR(5) เมื่อใช้วิธีกำลังสองน้อยสุด วิธีของ Yule-Walker และวิธีกำลังสองน้อยสุดที่มีการถ่วงน้ำหนักแบบมีส่วนลด เพื่อพยากรณ์ไปข้างหน้าทีละหนึ่งช่วงเวลา แต่พยากรณ์ติดต่อกันเป็นเวลานาน	70
11	ผลการวิเคราะห์ความแปรปรวนของกลุ่มตัวอย่างของค่าเศษส่วนเหลือจากการพยากรณ์เมื่อทราบว่าค่าเฉลี่ยของกระบวนการถดถอยบนตัวเองไม่เท่ากับศูนย์	71