

## เอกสารอ้างอิง

- ขวัญชนก สายศรีธิ. 2549. ปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีผลต่อการกำหนดดุลยภาพในระยะยาวของอัตราแลกเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ศราวุทธิ์ สิทธิกุล. 2540. พฤติกรรมราคาและการพยากรณ์ราคาสินค้าเกษตรที่สำคัญ กรณีศึกษา: ข้าว ยางพารา มันสำปะหลัง ข้าวโพด กุ้งกุลาดำ โดยวิเคราะห์และพยากรณ์เคลื่อนไหวของราคาสินค้าด้วยแบบจำลอง ARIMA. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- คมสัน สุริยะ. 2548. การพยากรณ์ราคาน้ำมันดิบด้วยแบบจำลอง Neural Networks. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิตติ ตันเสนีย์. 2549. การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์ราคาหลักทรัพย์ระหว่างแบบจำลองนิเวศเน็ตเวิร์คกับแบบจำลองอาร์มีมาและการ์ชเอ็ม. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิตรภรณ์ ฝั้นศิริ. 2547. การพยากรณ์ราคาส่งออกข้าวโดยวิธีอาร์มีมา. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศิริ แต่สมบัติ. 2539. เทคนิคการพยากรณ์เชิงปริมาณ. กรุงเทพฯ: ฟิสิกส์เซ็นเตอร์.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2550. ดุลการค้า ดุลบัญชีเดินสะพัด ดุลการชำระเงิน มูลค่าสินค้าออก และมูลค่าสินค้าเข้า. แหล่งที่มา: <http://www.bot.or.th>. (30 เมษายน 2550)
- นริสา สมุทรสาคร. 2547. การพยากรณ์ราคาทองคำโดยวิธีอาร์มีมา. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- ภัทร์ ตั้งตระกูล. 2546. วิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็มในหลักทรัพย์กลุ่มวัสดุ  
ก่อสร้างและตกแต่ง. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วัลลภา อุนวิจิตร. การพยากรณ์อนุกรมเวลาสำหรับราคาน้ำมันโดยนิเวศน์เวริก. วิทยานิพนธ์  
วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต ภาควิชาวิศวกรรมคอมพิวเตอร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- รัตนา เถลิว . 2549. ปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีผลต่อการกำหนดดุลยภาพในระยะยาวและการ  
ปรับตัวของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร  
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สรนพล วิเชียรรัตนพันธ์. 2547. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม:กรณีศึกษา  
หลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์. แบบฝึกหัดการวิจัย 751409 คณะเศรษฐศาสตร์  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อทิพันธ์ ศักดิ์ศรี. 2548. การวิเคราะห์เปรียบเทียบการพยากรณ์ราคาน้ำมันดิบเบรนท์ระหว่างแบบ  
จำลอง Neural Networks และARIMA. แบบฝึกหัดการวิจัย 751409 คณะเศรษฐศาสตร์  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อรทัย เมืองใจ. 2548. การวิเคราะห์เปรียบเทียบการพยากรณ์ราคาน้ำมันเครื่องบินเจ็ทระหว่างแบบ  
จำลอง Neural Networks และARIMA. แบบฝึกหัดการวิจัย 751409 คณะเศรษฐศาสตร์  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Baillie, R.T. and Bollerslve, T. 1992. "Prediction in Dynamic Model with Time-Dependent  
Condition Variance." **Journal of Economics** 52: 91-113
- Bollerslev, Tim. 1986. "Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity." **Journal  
of Econometrics** 31: 307-327. อ้างถึงใน สรนพล วิเชียรรัตนพันธ์. 2547. การวิเคราะห์  
ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม: กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนา  
อสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Box, G. and Jenkins, G. 1976. **Time series analysis; Forecasting and Control**. SanFranciso :  
Holden Day.
- Dickey, D. and Fuller, W. 1981. "Likelihood Ratio Statistics for Autoregressive Time Series with  
Unit Root." **Econometrica** 49: 987 – 1008.

- Enders, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series**. New York : John Wiley & sons.
- Engle, R., and Granger, Clive W. 1987. "Cointegration and Error - Correction Representation, Estimation, and Testing." **Econometrica** 55: 391-407. อ้างถึงใน จิตติ ตันเสนีย์. 2549. การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์ราคาหลักทรัพย์ระหว่างแบบจำลองนิเวศคณิตวิเคราะหกับแบบจำลองอาร์มาและการชเอ็ม. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Gujarati, Damodar N. 1995. **Basic Econometrics**. 3<sup>rd</sup> ed. New York: McGraw Hill.
- Komsan Suriya. 2006. "Forecasting Crude Oil Price Using Neural Networks. " **Chiang Mai University Journal** 5, 3(Sep-Dec): 377-385.
- Pindyck, R and Rubinfeld, D. 1998. **Econometric Models and Economic Forecasts**. 4<sup>th</sup> ed. New-York: McGraw-Hill.
- Said, S. and Dickey, D. 1984. "Testing for Unit Root in Auto Regressive-Moving Average Models with Unknown Order." **Biometrics** 71: 599-607.
- Schwert, G.W. and Seguin, P.J. 1990. "Heteroscedasticity in stock return." **Journal of Finance** 45: 1129-1155.