

## เอกสารอ้างอิง

- ชุตยารัตน์ เต็ดขาด. 2546. การวิเคราะห์ผลกระทบของการเคลื่อนไหวของอัตราแลกเปลี่ยนที่มีต่อระบบราคาและผลผลิตของประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่. แหล่งที่มา: [http://dcms.thailis.or.th/dcms/browse.php?option=show&browse\\_type=title&titleid=43022](http://dcms.thailis.or.th/dcms/browse.php?option=show&browse_type=title&titleid=43022) (25 กรกฎาคม 2550)
- ณรงค์ชัย จิตินันท์พงศ์. 2545. ผลกระทบของความผันผวนในอัตราแลกเปลี่ยนต่อระดับผลผลิต: แบบจำลองภาคการธนาคาร. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์. แหล่งที่มา: [http://dcms.thailis.or.th/dcms/browse.php?option=show&browse\\_type=title&titleid=19572](http://dcms.thailis.or.th/dcms/browse.php?option=show&browse_type=title&titleid=19572) (25 กรกฎาคม 2550)
- คำรพ รุ่งเรือง. 2543. แบบจำลองการคาดคะเนอัตราแลกเปลี่ยน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยรามคำแหง. แหล่งที่มา: [http://dcms.thailis.or.th/dcms/browse.php?option=show&browse\\_type=title&titleid=63913](http://dcms.thailis.or.th/dcms/browse.php?option=show&browse_type=title&titleid=63913) (25 กรกฎาคม 2550)
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิติ ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. “พฤติกรรมการณ์ส่งผ่านราคาทุ้มในตลาดระหว่างตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย” วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ (กันยายน-ธันวาคม): 16-51
- ชนินิ อนันตชาติ. 2544. ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนของไทยกับอัตราแลกเปลี่ยนในภูมิภาคเอเชีย : กรณีศึกษา ประเทศมาเลเซีย ฟิลิปปินส์ อินโดนีเซีย สิงคโปร์ เกาหลีใต้ ญี่ปุ่น (กรกฎาคม 2540-ธันวาคม 2543). วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์. แหล่งที่มา: [http://dcms.thailis.or.th/dcms/browse.php?option=show&browse\\_type=title&titleid=22310](http://dcms.thailis.or.th/dcms/browse.php?option=show&browse_type=title&titleid=22310) (25 กรกฎาคม 2550)
- นฤมล เขาวีวิทยากร. 2542. ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนในตลาดแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศกับตลาดหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ปิยบุษ เรืองขจร. 2550. การประมาณค่าความผันผวนของผลตอบแทนของราคาน้ำดิบ ถ่านหิน และก๊าซธรรมชาติ โดยวิธีอาร์มีอาร์ช อาร์มีอาร์ชเอ็มและอาร์มีอาร์ช. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ภัทร์ ตั้งตระกูล. 2545. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองอาร์ชเอ็ม : กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุก่อสร้างและตกแต่ง. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. 2531. การวิเคราะห์อนุกรมเวลา: ตำราประกอบการเรียนวิชาอนุกรมเวลา และเลขดัชนี. มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ มหาสารคาม.

สายสุดา จันทรา. 2547. ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศกับดัชนีตลาดหลักทรัพย์บางประเทศในเอเชีย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

สุกัญญา เซษฐโชติรส. 2545. ความผันผวนในอัตราแลกเปลี่ยนที่มีต่อการส่งออกของประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยรามคำแหง. แหล่งที่มา: [http://dcms.thailis.or.th/dcms/browse.php?option=show&browse\\_type=title&titleid=63743](http://dcms.thailis.or.th/dcms/browse.php?option=show&browse_type=title&titleid=63743) (25 กรกฎาคม 2550)

Black, F. 1976. "Studies of stock price volatility changes, Proceedings of the American Statistical Association." **Business and Economic Statistics Section** p. 177-181.

Bollerslev, Tim. 1986. "Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity." **Journal of Econometrics** 31: 307-327.

Box, G.E.P. and Jenkins, G.M. 1976. **Time Series Analysis Forecasting and control**. San Francisco, CA: Holden-Day Inc.

Enders, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series**. New York: John Wiley & Sons.

Goyal, Amit. 2000. **Predictability of Stock Return Volatility from GARCH Model**.

Available:<http://bus.emory.edu/Agoya/docs/Garch.pdf> (15 January 2007)

- Gujarati, Damodar N. 1995. **Basic Econometrics**. 3<sup>rd</sup> ed. New York: McGraw Hill.
- Najand, Mohammad. 2002. "Forecasting Stock Index Future Price Volatility: Linear vs. Nonlinear Models." **The Financial Review** 37: 93-104.
- Nelson, Daniel B. 1991. "Conditional heteroskedasticity in asset returns: a new approach" **Econometrica** 59, 2: 347-370.
- Pindyck, R and Rubinfeld, D. 1998. **Econometric Models and Economic Forecasts**. 4<sup>th</sup> ed. New-York: McGraw-Hill.
- Reuters. 2007. **Reuters Kobra™ Version 3.5.1**. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University (13 July 2007)
- Wold, H. 1938. **A study in the Analysis of Stationary Time Series**. 1<sup>st</sup> ed. Stockholm: Almqvist & Wiksell.