

## เอกสารอ้างอิง

- กชพร ทองจิตติพงศ์. (2549). การพยากรณ์ราคาเมล็ดกาแฟดิบโดยวิธีอาร์มา. แบบฝึกการวิจัยด้าน  
เศรษฐศาสตร์ เศรษฐศาสตรบัณฑิต, มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- คมสัน สุริยะ. การวิจัยทางด้านเศรษฐศาสตร์ด้วย Neural Networks. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก :  
<http://www.tourismlogistics.com/2008-12-24-05-09-59/anns-model/124-economic-research-with-neural-networks.html> (วันที่ค้นข้อมูล : 23 เมษายน 2553).
- จตุพร จันตะโมกษ์. (2550). การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์ราคาน้ำมันดิบระหว่าง  
แบบจำลองนิเวรอลเน็ตเวิร์ค กับแบบจำลองอาร์มาการซ์เอ็ม. การค้นคว้าแบบอิสระ  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต, บัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิตติ ตันเสนีย์. (2549). การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์ราคาหลักทรัพย์ระหว่าง  
แบบจำลองนิเวรอลเน็ตเวิร์ค กับแบบจำลองอาร์มาและอีการซ์เอ็ม. การค้นคว้าแบบ  
อิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต, บัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ฉลอง สีแก้วล้วน. การทดสอบความเป็นการกระจายแบบปกติ. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : [http://www.statistics.ob.tc/normal\\_test.htm](http://www.statistics.ob.tc/normal_test.htm) (วันที่ค้นข้อมูล : 8 มิถุนายน 2553).
- ทรงศิริ แต่สมบัติ. (2549). การพยากรณ์เชิงปริมาณ. กรุงเทพฯ : สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัย  
เกษตรศาสตร์.
- นนทพร จำปาวาน. (2550). การประมาณค่าความผันผวนสำหรับอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศไทย  
โดยแบบจำลองอาร์มา และแบบจำลองอาร์มาอีการซ์. การค้นคว้าแบบอิสระ  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต, บัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- นริสา สมุทรสาคร. (2547). การพยากรณ์ราคาทองคำโดยวิธีอาร์มา. การค้นคว้าแบบอิสระ  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต, บัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- นุชศรา เกสรประทุม. (2550). การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์ราคาทองคำระหว่าง  
แบบจำลองนิเวรอลเน็ตเวิร์ค กับแบบจำลองอาร์มา แบบจำลองการซ์เอ็ม. การค้นคว้า  
แบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต, บัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปัทมา อริยะวงศ์. (2550). การพยากรณ์มูลค่าส่งออกกาแฟดิบโดยวิธีอาร์มา. การค้นคว้า  
แบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต, บัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- ปริญญ์ วิสุทธิเมธากุล. (2550). การทดสอบประสิทธิภาพของ Algorithm ต่างๆ ในการ Train เพื่อลดสัญญาณรบกวนโดยใช้ Neural Network . รายงานภาควิชาวิศวกรรมไฟฟ้า, คณะวิศวกรรมศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่. (สำเนา).
- ปิยนุช เรืองขจร. (2548). การประมาณค่าความผันผวนของผลตอบแทนของราคาน้ำมันดิบ ถ่านหิน และก๊าซธรรมชาติ โดยวิธีอาร์มีเอการ์ช อาร์มีเอการ์ชเอ็ม และอาร์มีเอการ์ช. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต, บัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- มุกดา แม่นมินทร์. (2549). อนุกรมเวลาและการพยากรณ์. กรุงเทพฯ : สำนักพิมพ์ประกายพริก
- เริงชัย ต้นสุชาติ. (2548). เศรษฐมิติ. เชียงใหม่ : โรงพิมพ์ไทนคัลเลอร์
- ภาณุรณ ฉัตรชัยการ. (2551). การประมาณค่าความผันผวนและพยากรณ์มูลค่ากองทุนเพื่อการเลี้ยงชีพ และกองทุนระยะยาวโดยใช้แบบจำลองอาร์มีเอการ์ช และอาร์มีเอการ์ช. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต, บัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สำนักงานนโยบายและแผนพลังงาน, กระทรวงพลังงาน. ข้อมูลทางสถิติด้านพลังงาน. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : <http://www.eppo.go.th/index-T.html> (วันที่ค้นข้อมูล : 16 มกราคม 2553).
- อรทัย เมืองใจ. (2548). วิเคราะห์เปรียบเทียบการพยากรณ์ราคาน้ำมันเครื่องบินเจ็ทระหว่างแบบจำลอง Neural Networks และ ARIMA. แบบฝึกการวิจัยด้านเศรษฐศาสตร์ เศรษฐศาสตรบัณฑิต, มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อัศวพงษ์ อินทอง. คู่มือการใช้โปรแกรม EViews เบื้องต้น : สำหรับการวิเคราะห์ทางเศรษฐมิติ. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : [http://www.pyo.nu.ac.th/economics/Aun/data/%E0%B8%84%E0%B8%B9%E0%B9%88%E0%B8%A1%E0%B8%B7%E0%B8%AD%E0%B8%81%E0%B8%B2%E0%B8%A3%E0%B9%83%E0%B8%8A%E0%B9%89%E0%B9%82%E0%B8%9B%E0%B8%A3%E0%B9%81%E0%B8%81%E0%B8%A3%E0%B8%A1\\_Eviews.pdf](http://www.pyo.nu.ac.th/economics/Aun/data/%E0%B8%84%E0%B8%B9%E0%B9%88%E0%B8%A1%E0%B8%B7%E0%B8%AD%E0%B8%81%E0%B8%B2%E0%B8%A3%E0%B9%83%E0%B8%8A%E0%B9%89%E0%B9%82%E0%B8%9B%E0%B8%A3%E0%B9%81%E0%B8%81%E0%B8%A3%E0%B8%A1_Eviews.pdf) (วันที่ค้นข้อมูล : 16 กันยายน 2552).
- อัศวพงษ์ อินทอง. คู่มือการใช้โปรแกรม EViews เพื่อการวิเคราะห์ Unit Root, Cointegration และ Error Correction Model (ตามวิธีการของ Engle and Granger). [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : [http://www.nidambell.net/ekonomiz/eview\\_doc/unit\\_root\\_cointegration.pdf](http://www.nidambell.net/ekonomiz/eview_doc/unit_root_cointegration.pdf)
- อดิเรก จันทร์สวด. (2550). การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศระหว่างแบบจำลองนิเวรอลเน็ตเวิร์ค แบบจำลองอาร์มีเอการ์ชเอ็ม. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต, บัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อทิพันธ์ ศักดิ์ศรี. (2548). การวิเคราะห์เปรียบเทียบการพยากรณ์ราคาน้ำมันดิบเบรนท์ระหว่างแบบจำลอง Neural Networks และ ARIMA. แบบฝึกการวิจัยด้านเศรษฐศาสตร์ เศรษฐศาสตรบัณฑิต, มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- Bhokha, S., and S.O. Ogunlana. (1993). Application of Artificial Neural Network to Forecast Construction Duration of Buildings at the Predesign Stage. **Engineering Construction and Architectural Management**. 6(2), 133 – 144.
- Bollerslev, T. (1986). Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity. **Journal of Econometrics**. 31, 307-327.
- Bollerslev, T. (2008). **Glossary to ARCH (GARCH)**. working paper
- Diebold, F.X. (2004). **The Nobel Memorial Prize for Robert F. Engle**. The Wharton Financial Institutions Center.
- Engle, R.F. (1982). Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimates of Variance of United Kingdom Inflation. **Econometrica**. 50, 987-1008.
- Engle, R.F. (2001). GARCH 101 : The Use of ARCH/GARCH Models in Applied Econometrics. **Journal of Economic Perspectives**. 15(4), 157-168.
- Energy Information Administration. **Petroleum**. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : [http://www.eia.doe.gov/oil\\_gas/petroleum/info\\_glance/petroleum.html](http://www.eia.doe.gov/oil_gas/petroleum/info_glance/petroleum.html) (วันที่ค้นข้อมูล : 19 กุมภาพันธ์ 2553).
- Fausett, L.V. (1994). **Fundamentals of Neural Networks : Architectures, Algorithms, and Applications**. Englewood Cliffs NJ : Prentice Hall.
- Frain, J. (1992). **Lecture Notes on Univariate Time Series Analysis and Box-Jenkins Forecasting**. (reprinted with revision).
- Haykin, S. (1994). **Neural Networks : A Comprehensive Foundation**. New York : MacMillan College Publishing Company.
- Hornik K., M. Stinchcombe, and H. White. (1989). Multilayer Feedforward Networks are Universal Approximators. **Neural Networks**. 2(5), 359–366.
- Hoptroff, R. G. (1993). The Principles and Practice of Time Series Forecasting and Business Modelling Using Neural Nets. **Neural Computing and Applications**. 1(1), 59-66.
- International Energy Agency. **Energy Statistics of Non-OECD Countries**. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : <http://www.iea.org/stats/index.asp> (วันที่ค้นข้อมูล : 4 พฤษภาคม 2553).
- Jarque, C.M. and, A.K. Bera. (1980). Efficient Tests for Normality, Homoscedasticity and Serial Independence of Regression Residuals. **Economics Letters**. 6(3), 255–259.
- Kohzadi, N., M.S. Boyd., et al. (1995). Neural Networks for Forecasting : An Introduction **Canadian Journal of Agricultural Economics**. 43(3 ), 463–474.

- Ljung, G.M., and G.E.P. Box. (1978). On a Measure of a Lack of Fit in Time Series Models. **Biometrika**. 65, 297–303.
- McCulloch, W., and W. Pitts. (1943). A Logical Calculus of the Ideas Immanent in Nervous Activity. **Bulletin of Mathematical Biophysics**. 7, 115 - 133.
- Markridakis, S., Wheelwright, S.C. and Hyndman, R.J., (1998). **Forecasting Methods and Applications**, 3<sup>rd</sup> ed. Wiley, New York
- Marquandt, D.W. (1963). An Algorithm for Least-Squares Estimation of Nonlinear Parameters. **SIAM Journal on Applied Mathematics**. 11, 431–441.
- Nelson, D.B. (1991). Conditional heteroskedasticity in asset returns : A new approach. **Econometrica**. 59, 347-370.
- Quantitative Micro Software. (2004). **EViews User Guide version 5.1**. Irvine, California : Campus Drive.
- Said, E., and D.A. Dickey. (1984). Testing for Unit Roots in Autoregressive Moving Average Models of Unknown Order. **Biometrika**. 71, 599–607.
- Suriya, K. (2006). Forecasting Crude Oil Price Using Neural Networks. **Chiang Mai University Journal**. 5(3), 377-385.
- Wikimedia Foundation, Inc. **Autoregressive Conditional Heteroskedasticity**. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : [http://en.wikipedia.org/wiki/Autoregressive\\_conditional\\_heteroskedasticity](http://en.wikipedia.org/wiki/Autoregressive_conditional_heteroskedasticity) (วันที่ค้นข้อมูล : 12 กุมภาพันธ์ 2553).
- Wikimedia Foundation, Inc. **Augmented Dickey–Fuller Test**. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : [http://en.wikipedia.org/wiki/Augmented\\_Dickey%E2%80%93Fuller\\_test](http://en.wikipedia.org/wiki/Augmented_Dickey%E2%80%93Fuller_test) (วันที่ค้นข้อมูล : 27 มกราคม 2553).
- Wikimedia Foundation, Inc. **Autocorrelation**. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : <http://en.wikipedia.org/wiki/Autocorrelation> (วันที่ค้นข้อมูล : 27 มกราคม 2553).
- Wikimedia Foundation, Inc. **Autoregressive Integrated Moving Average**. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : [http://en.wikipedia.org/wiki/Autoregressive\\_integrated\\_moving\\_average](http://en.wikipedia.org/wiki/Autoregressive_integrated_moving_average) (วันที่ค้นข้อมูล : 27 มกราคม 2553).
- Wikimedia Foundation, Inc. **Autoregressive model**. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : [http://en.wikipedia.org/wiki/Autoregressive\\_model](http://en.wikipedia.org/wiki/Autoregressive_model) (วันที่ค้นข้อมูล : 27 มกราคม 2553).

Wikimedia Foundation, Inc. **Autoregressive Moving Average Model**. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : [http://en.wikipedia.org/wiki/Autoregressive\\_moving\\_average\\_model](http://en.wikipedia.org/wiki/Autoregressive_moving_average_model) (วันที่ค้นข้อมูล : 27 มกราคม 2553).

Wikimedia Foundation, Inc. **Box–Jenkins**. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : <http://en.wikipedia.org/wiki/Box-Jenkins> (วันที่ค้นข้อมูล : 27 มกราคม 2553).

Wikimedia Foundation, Inc. **Feedforward Neural Network**. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : [http://en.wikipedia.org/wiki/Feedforward\\_neural\\_network](http://en.wikipedia.org/wiki/Feedforward_neural_network) (วันที่ค้นข้อมูล : 17 กรกฎาคม 2553).

Wikimedia Foundation, Inc. **Jarque–Bera Test**. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : [http://en.wikipedia.org/wiki/Jarque%E2%80%93Bera\\_test](http://en.wikipedia.org/wiki/Jarque%E2%80%93Bera_test) (วันที่ค้นข้อมูล : 27 มกราคม 2553).

Wikimedia Foundation, Inc. **Levenberg–Marquardt Algorithm**. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : [http://en.wikipedia.org/wiki/Levenberg%E2%80%93Marquardt\\_algorithm](http://en.wikipedia.org/wiki/Levenberg%E2%80%93Marquardt_algorithm) (วันที่ค้นข้อมูล : 17 กรกฎาคม 2553).

Wikimedia Foundation, Inc. **Ljung–Box Test**. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : [http://en.wikipedia.org/wiki/Ljung%E2%80%93Box\\_test](http://en.wikipedia.org/wiki/Ljung%E2%80%93Box_test) (วันที่ค้นข้อมูล : 27 มกราคม 2553).

Wikimedia Foundation, Inc. **Moving Average**. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : [http://en.wikipedia.org/wiki/Moving\\_average](http://en.wikipedia.org/wiki/Moving_average) (วันที่ค้นข้อมูล : 27 มกราคม 2553).

Wikimedia Foundation, Inc. **Ordinary Least Squares**. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : [http://en.wikipedia.org/wiki/Ordinary\\_least\\_squares](http://en.wikipedia.org/wiki/Ordinary_least_squares) (วันที่ค้นข้อมูล : 27 มกราคม 2553).

Wikimedia Foundation, Inc. **Partial Autocorrelation Function**. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : [http://en.wikipedia.org/wiki/Partial\\_autocorrelation\\_function](http://en.wikipedia.org/wiki/Partial_autocorrelation_function) (วันที่ค้นข้อมูล : 27 มกราคม 2553).

Wikimedia Foundation, Inc. **White Noise**. [ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : [http://en.wikipedia.org/wiki/White\\_noise](http://en.wikipedia.org/wiki/White_noise) (วันที่ค้นข้อมูล : 27 มกราคม 2553).