

## บรรณานุกรม

กรมส่งเสริมการเกษตร ศูนย์สารสนเทศ .2550. การส่งออกสินค้าเกษตร. [ระบบออนไลน์].

แหล่งที่มา : <http://www.ictc.doae.go.th/>

จิตรภรณ์ ผืนศิริ .2547. การพยากรณ์ราคาส่งออกข้าวโดยวิธีอาร์มีมา. การค้นคว้าอิสระ  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ชัชวาลย์ อินทร์ภัย.2554. ทิศทางเศรษฐกิจและผลกระทบต่อภาคการเกษตร . [เอกสาร  
ประกอบการบรรยาย]. ธนาคารแห่งประเทศไทย สำนักงานภาคเหนือ.

ฉันทิวร เทียนแป้น. 2552. การพยากรณ์ราคาน้ำมันดิบไลท์สวีท และน้ำมันสำเร็จรูป

เบนซินในตลาดฟิวเจอร์ในเม็กซิโกโดยใช้แบบจำลองอาร์ฟี่มา.

การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่ : คณะเศรษฐศาสตร์  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

นริสา สมุทรสาคร. 2547. การพยากรณ์ราคาทองคำโดยวิธีอาร์มีมา. การค้นคว้าแบบอิสระ  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ราชพล สุนทรศรี. 2548. การพยากรณ์ราคาน้ำมันดิบโดยวิธีอาร์มีมา. การค้นคว้าแบบอิสระ  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ลำปาง แสงจันทร์.2549. **Time Series Analysis**. เอกสารประกอบการเรียน ภาควิชาสถิติ  
คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

สมาคมโรงงานน้ำตาล 3 สมาคม.2522. ราคาน้ำตาลที่กำหนดในประกาศคณะกรรมการกลาง  
กำหนดราคาสินค้าและป้องกันการผูกขาด (พ.ศ. 2522 – 2542) และกำหนดในประกาศ  
คณะกรรมการกลางว่าด้วยราคาสินค้าและบริการ (พ.ศ. 2543 – ปัจจุบัน).

[ระบบออนไลน์]. แหล่งที่มา :

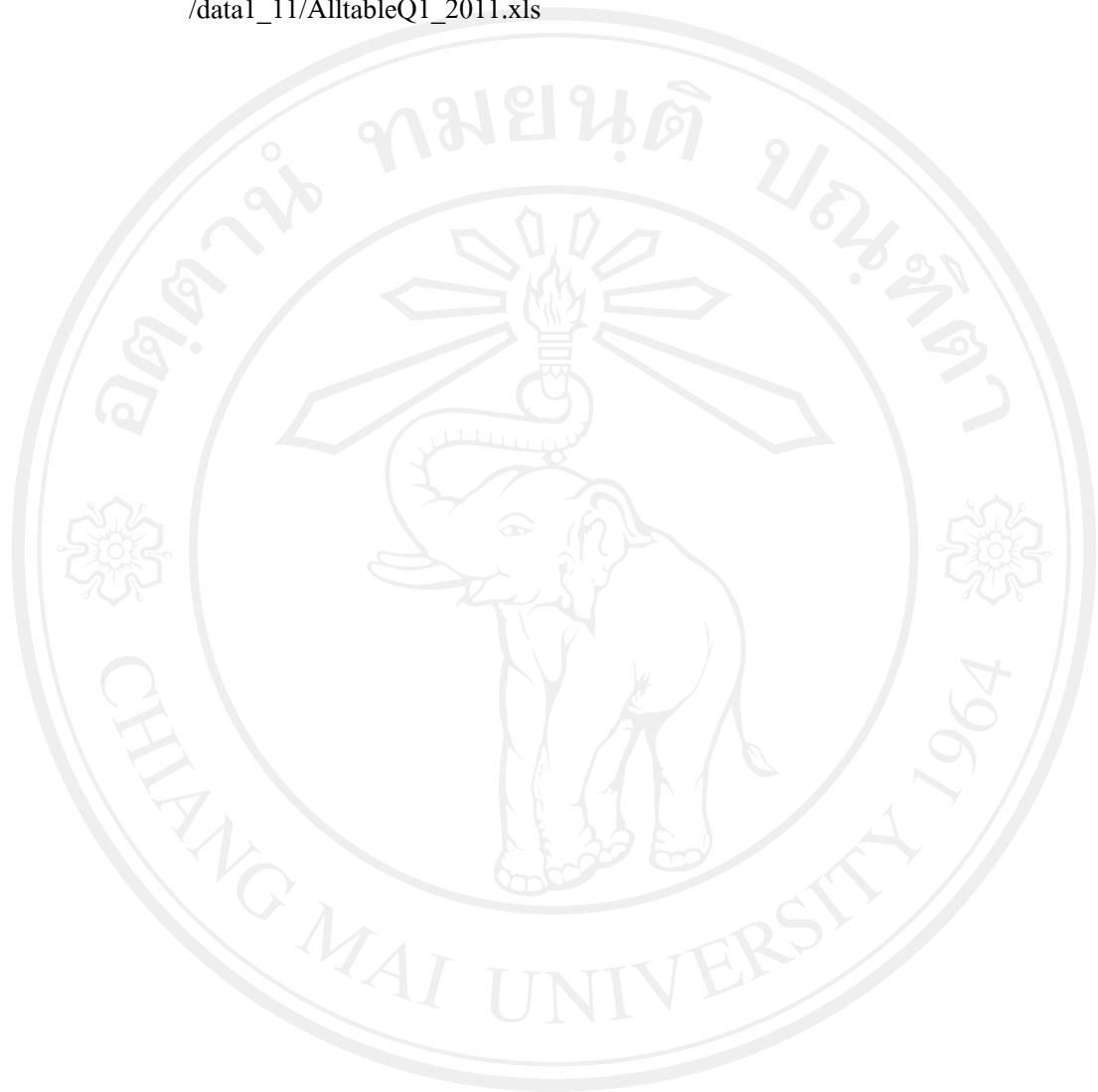
[www.thaisugarmillers.com/tsmc-01-01.html](http://www.thaisugarmillers.com/tsmc-01-01.html)

สำนักงานคณะกรรมการพัฒนาเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ.2553. มูลค่าการผลิต ของภาค

การเกษตร ภาคอุตสาหกรรม ภาคบริการ.[ระบบออนไลน์]. แหล่งที่มา :

[http://www.nesdb.go.th/Portals/0/eco\\_datas/account/qgdp](http://www.nesdb.go.th/Portals/0/eco_datas/account/qgdp)

/data1\_11/AlltableQ1\_2011.xls



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

สำนักงานสถิติแห่งชาติ กระทรวงเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร. 2550. การสำรวจ  
ภาวะการมีงานทำของประชากร ทัวราชอาณาจักร. [ระบบออนไลน์]

<http://www2.dede.go.th/tis54/fulltext/TIS56-2552.pdf>

สำนักงานเศรษฐกิจการเกษตร. 2554. สถิติการส่งออก. [ระบบออนไลน์]. แหล่งที่มา :

[http://www.oae.go.th/oae\\_report/export\\_import/export.php](http://www.oae.go.th/oae_report/export_import/export.php)

Alptekin, N. 2006. **Long Memory Analysis of USD/TRL Exchange Rat.** International  
Journal of Human and Social Sciences.

Barkoulas, J. and Baum, C. 1997. **LONG MEMORY AND FORECASTING IN EUROYEN  
DEPOSIT RATES.** Department of Economics Boston College.

Box, G.E.P, and G. Jenkin. 1970. **Time Series Analysis, Forecasting and Control,** Holden-  
Day, Oakland, Calif.

Brunetti, C. 1999. **LONG MEMORY, THE “TAYLOR EFFECT” AND INTRADAY  
VOLATILITY IN COMMODITY FUTURES MARKETS.** Edinburgh: The  
University of Edinburgh.

Chiawa, M.; Asare, B. and Audu, B. 2010. **Short and Long Memory Time Series Models of  
Relative Humidity of Jos Metropolis.** Research Journal of Mathematics and  
Statistics 2(1): 23-31.

Chukiat Chaiboonsri, et.al. 2010. **International Tourist arrivals in Thailand : Forecasting  
with ARFIMA- FIGARCH Approach.** [online] Available  
[http://www.scribd.com/doc/27858486/T0urism-Eco- No\\_Metrics-1-2001\(20 January  
2011\).](http://www.scribd.com/doc/27858486/T0urism-Eco- No_Metrics-1-2001(20 January 2011))

Emrah Ismail ; Cevik , Nesrin Ozatac and Turhan Korkmaz. 2009. **Testing for Long Memory  
in ISE Using ARIMA-FIGARCH Model and Structural Break Test.** [online]

Available : <http://www.eurojournals.com/finance.htm>. (20 January 2011)

Enders, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series.** Nee York: Wiley.

Granger, C.W.J. and Pierre L. Siklos. 1995. **Systematic Sampling, Temporal Aggregation,  
Seasonal Adjustment, and Cointegration: Theory and Evidence,** Journal of  
Econometrics, 66:357-69.

- Geweke, J.F. and S. Richardson, and Porter-Hudak. 1983. The estimation and application of Long memory time series models. *J. Time Series Anal.*, 4, 221-238.
- Gujarati, D.N. 1995. **Basic Econometrics**, Singapore:McGraw Hill.
- Hamilton, J.D. 1994. **Time Series Analysis**, Princeton University Press Princeton, New Jersey.
- Hosking, J. R. M. 1981. **Fractional differencing**. *Biometrika*, 68:165-17.
- Komsan Suriya. 2006. **Forecasting Crude Oil Price Using Neural Networks**. Chiang Mai University Journal 5, 3 (September-December): 377-385.
- Lewis, C.D. 1982. **Industrial and business forecasting methods: A radical guide to exponential smoothing and curve fitting**. London, Boston: Butterworth Scientific :305.
- Lo, A. 1991. **Long-Term Memory in Stock Market Prices**, *Econometrica* 59, 1279-1313.
- Mandelbrot, B.B., and J. Wallis. 1969. **Roboustness of rescaled rang R/S in measurement of noncyclic long run statical dependence**, *Water Resour. Res.*, 5(5), 967-988.
- Wang, W. et al. 2006. **Detecting long-memory: Monte Carlo simulations and application to daily streamflow processes**. *Journal Hydrology and Earth System Sciences*.
- Wold, H. 1985. "Partial Least Squares," in **Encyclopedia of Statistical Sciences (Volume 6)**, New York: Wiley : 581-591.