

## เอกสารอ้างอิง

กรมเชื้อเพลิงธรรมชาติ. 2554. **ทำไมต้องอ้างอิงราคาน้ำมันสำเร็จรูป ณ ประเทศสิงคโปร์?**

แหล่งที่มา: <http://www.dmf.go.th/index.php?act=service&sec=faq&page=2> (25 กันยายน 2554)

กมลรัตน์ ป้อมสุวรรณ และคณะ. 2550. **พลังงานกับชีวิต: เอกสารประกอบการสอนวิชา วิทยาศาสตร์เพื่อคุณภาพชีวิต.** แหล่งที่มา:

<http://www2.udru.ac.th/~sci102/Data/Unit4/Unit4-2.htm> (15 กันยายน 2554)

คมสัน สุริยะ. 2548. **การพยากรณ์ราคาน้ำมันดิบด้วยแบบจำลองนิเวศเน็ตเวิร์ค.** ศูนย์การวิเคราะห์เชิงปริมาณ คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

จตุพร จันตะโมกษ์. 2550. **การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์ราคาน้ำมันดิบระหว่างแบบจำลองนิเวศเน็ตเวิร์ค กับแบบจำลองอาร์มาการ์ชเอ็ม.** การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

จุฬาวินยานุกรม. 2010. **น้ำมันดิบ (Crude Oil).** แหล่งที่มา

<http://www.chulapedia.chula.ac.th/index.php> (19 กันยายน 2554)

บุญน้อย ศักดิ์ใหญ่. 2551. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนในการลงทุนในหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยด้วยเทคนิค Value at Risk.** การประเมินผลหลักสูตรประกาศนียบัตรวิชาชีพครู วิทยาลัยนอร์ทกรุงเทพ.

ประกายแก้ว รุ่งเรือง. 2553. **การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ที่สำคัญกับราคาน้ำมันในตลาดโลก โดยวิธีโคอินทิเกรชัน.** การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ปิยบุษ เรืองขจร. 2550. **การประมาณค่าความผันผวนของผลตอบแทนของราคาน้ำมันดิบ ถ่านหิน และก๊าซธรรมชาติ โดยวิธีอาร์มาอิการ์ช อาร์มาการ์ชเอ็ม และอาร์มาการ์ช.** การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

พรพิมล วรรณทอง. 2553. **การพยากรณ์ราคาหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยด้วยอาร์มา-ไฟการ์ช.** การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ฉันทิธร เทียนแป้น. 2552. การพยากรณ์ราคาน้ำมันดิบไลต์สวีท และน้ำมันสำเร็จรูปเบนซินในตลาดฟิวเจอร์ในแม็กซ์โดยการใช้แบบจำลองอาร์พีมา. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตี: ทฤษฎีและการประยุกต์. พิมพ์ครั้งที่ 1. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ชนวิวัฒน์ มุสิก และคณะ. 2551. **World population**. แหล่งที่มา :

[http://cpe.kmutt.ac.th/wiki/index.php/--.World\\_population](http://cpe.kmutt.ac.th/wiki/index.php/--.World_population). (29 กันยายน 2554)

ภัทรรัตน์ พัวพันพัฒนา. 2553. การพยากรณ์ผลตอบแทนหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธี อาฟี่แมกซ์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ราชพล สุนทรศรี. 2548. การพยากรณ์ราคาน้ำมันดิบโดยวิธีอาร์มา. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

วิทยาลัยสารพัดช่างพระนคร. 2551. เอกสารประกอบการสอนวิชาพลังงานและสิ่งแวดล้อม.

แหล่งที่มา [http://www.bpc.ac.th/knowledge/article/Unit\\_1.pdf](http://www.bpc.ac.th/knowledge/article/Unit_1.pdf) (20 กันยายน 2554)

ศุภชัย ศรีสุชาติ. 2546. แนวบรรยายวิชาเศรษฐศาสตร์เบื้องต้น ( ศ.210 ) ภาค 2 ปีการศึกษา 2546.

แหล่งที่มา [econ.tu.ac.th/class/archan/...2.../out210\\_2\\_46.doc](http://econ.tu.ac.th/class/archan/...2.../out210_2_46.doc) (21 กันยายน 2554)

สำนักงานคณะกรรมการกำกับและส่งเสริมการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์. 2555. ความหมายและความสัมพันธ์ของ Cash Price และ Futures Price: ศูนย์พัฒนาความรู้การซื้อขายสินค้าเกษตรล่วงหน้า. แหล่งที่มา : [http://www.aftc.or.th/itc/analyze\\_1\\_7.php](http://www.aftc.or.th/itc/analyze_1_7.php). (29 กันยายน 2554)

อภิมุข เกียรติศิริกุล. 2554. การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์ราคาน้ำมันดิบดูไบระหว่างตัวแบบบ็อกซ์และเจนคินส์ ตัวแบบการ์ชและตัวแบบโครงข่ายประสาทประดิษฐ์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

อรนุช อุทานนท์. 2551. ความรู้เกี่ยวกับพลังงาน: เอกสารประกอบการสอนวิชาพลังงานและสิ่งแวดล้อม. แหล่งที่มา : [http://www.bpc.ac.th/knowledge/article/Unit\\_1.pdf](http://www.bpc.ac.th/knowledge/article/Unit_1.pdf) (20 กันยายน 2554)

อุทิศ นุ่นแก้ว. 2550. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราเงินเฟ้อของประเทศไทยและราคาน้ำมันดิบในตลาดโลก โดยวิธีการโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- Akaike, H. 1974. "A New Look at the Statistical Model Identification." **IEEE Transactions on Automatic Control**. 19: 716-722.
- Alvarez-Ramirez, J.; Alvarez J. and Rodriguez, E. 2008. "Short-term predictability of crude oil markets: A detrended fluctuation analysis approach." **Energy Economics** 30, 5 (September): 2645-2656.
- Armstrong, J.S. and Collopy, F. 1992. "Error Measures For Generalizing About Forecasting Methods: Empirical Comparisons." **International Journal of Forecasting** 8, 1 (June): 69-80.
- Baillie, R.T.; Bollerslev, T. and Mikkelsen, H.O. 1996. "Fractionally integrated generalized autoregressive conditional heteroskedasticity." **Journal of Econometrics** 74: 3-30.
- Bardos, S. 2008. Academy of Economics Studies Bucharest Doctoral School of Finance and Banking DOFIN. Buchaerest. n.p.
- Box, G. E. P. and Jenkins, G. M. 1976. **Time Series Analysis: Forecasting and Control**. Revised Edition. San Francisco: Holden-Day.
- Dickey, D. and Fuller, W. 1979. "Distribution of Estimators for Autoregressive Time Series With a Unit Root." **Journal of the American Statistical Association** 74, 366 (June): 427-431.
- Doan, T.; Litterman, R. and Sims, C.A. 1984. "Forecasting and Conditional Projection Using Realistic Prior Distributions." **Econometric Reviews**. 3:1-144.
- Elliott, G.; Rothenberg, T.J. and Stock, J.H. 1996. "Efficient tests for an autoregressive unit root." **Econometrica** 64(4): 813-836.
- Embrechts, P.; Kluppelberg, C. and Mikosch, T. 1997. **Modelling Extremal Events for Insurance and Finance**. Berlin. Springer.
- Fiszeder, P. 2008. **Dynamic Econometric Model**. Available:  
[http://www.dem.umk.pl/dem/archiwa/v8/14\\_Fiszeder.pdf](http://www.dem.umk.pl/dem/archiwa/v8/14_Fiszeder.pdf). (26 March 2010)
- Frechtling, D.C. 1996. **Practical Tourism Forecasting**. Oxford: Butterworth-Heinemann.
- Friedman, J.W. 1983. **Oligopoly Theory**. Cambridge, UK: Cambridge University Press.
- Riley, G. 2006. **As Market & Market System: Market for Oil**. Eton: Eton College.
- Geweke, J. and Porter-Hudak, S. 1983. "The estimation and application of long memory time series models." **Journal of Time Series Analysis** 4: 221-38.

- Granger, C. W. J. and Joyeux, R. 1980. "An Introduction to Long-memory Time Series Models and Fractional Differencing." **Journal of Time Series Analysis** 1, 1 (29 January): 15-39.
- Gujarati, D.N. 2003. Basic econometrics. 3<sup>rd</sup> ed. New York: McGraw-Hill.
- Hannan, E.J., and Quinn, B.G. 1979. "The Determination of the Order of an Autoregressive." **Journal of the Royal Statistical Society** B41: 190-195.
- Hosking, J. R. M. 1981. "Fractional Differencing." **Biometrika**. 68: 165-176.
- Hou, A. and Suardi, S. 2011. "A nonparametric GARCH model of crude oil price return volatility." **Energy Economics** 34, 618-626.
- Hurst, H.E. 1951. "Long-term storage capacity of reservoirs." **Transactions of the American Society of Civil Engineers** 116: 70-799.
- Lewis, C. D. 1982. **Industrial and business forecasting methods**. London: Butterworth Scientific.
- Lo, A.W. 1991. "Long-term memory in stock market prices." **Econometrica** 59: 1279-1313
- Kilian, L. 2009. **Oil Price Volatility: Origins and Effects**. Available: [http://www.wto.org/ENGLISH/res\\_e/reser\\_e/ersd201002\\_e.pdf](http://www.wto.org/ENGLISH/res_e/reser_e/ersd201002_e.pdf) (23 September 2011)
- Mandelbrot, B.B. and Wallis, J.R. 1969. "Robustness of the rescaled range R/S in the measurement of noncyclic long run statistical dependence." **Water Resources Research** 5, 5: 967-988.
- Oxford University. 2009. **Oxford Dictionary of Economics**. Oxford: Oxford University.
- Parker, B. 2002. **Planning analysis**. Available: <http://pages.uoregon.edu/rgp/PPPM613/class8a.htm> (20 September 2011)
- Phillips, P. C. B., and Perron, P. 1988. "Testing for a Unit Root in Time Series Regression." **Biometrika** 75, 2: 335-346.
- Said, S.E. and Dickey, D.A. 1984. "Testing for Unit Roots in Autoregressive Moving Average Models of Unknown Order." **Biometrika** 71, 3: 599-607.
- Schwarz, G. E. 1978. "Estimating the Dimension of a Model." **Annals of Statistics**. 6: 461-464.

Tansuchai, R.; McAleer, M. and Chang, C. 2009. **Volatility spillovers between crude oil futures returns and oil company stock return.** Available:

[http://www.mssanz.org.au/modsim09/D4/tansuchat\\_D4a.pdf](http://www.mssanz.org.au/modsim09/D4/tansuchat_D4a.pdf) (21 September 2011)

Tansuchat, R. 2009. **Modelling World Crude Oil Prices Volatility and Volatility Spillovers.**  
Doctor of Philosophy of Economics Chiang Mai University.

U.S. Energy Information Administration. 2011a. **INTERNATIONAL ENERGY OUTLOOK 2011.** Available : <http://www.eia.gov/forecasts/ieo/world.cfm> (23 September 2011)

U.S. Energy Information Administration. 2011b. **WHAT DRIVES CRUDE OIL PRICES?.**  
Available : <http://www.eia.gov/finance/markets> (29 November 2011)

Wei, Y.; Wang, Y. and Huang, D. 2010. “Forecasting crude oil market volatility: Further evidence using GARCH-class models.” **Energy Economics.** 32, 1477-1484.