

เอกสารอ้างอิง

- กรมเจรจาการค้าระหว่างประเทศ. 2550. สถิติมูลค่าการนำเข้าพลังงานของประเทศไทย.
แหล่งที่มา: http://www.ops2.moc.go.th/trade/trade_imp.html (10 พ.ย.2549)
- กระทรวงพลังงาน. สำนักงานนโยบายและแผนพลังงาน. 2550. มูลค่าการใช้พลังงานและมูลค่าการใช้พลังงานรวมต่อผลิตภัณฑ์มวลรวมในประเทศ (GDP) ตามราคาตลาด.
แหล่งที่มา: http://www.eppo.go.th/info/stat/t07_02_04.xls (10 ม.ค.2550)
- _____. 2550. สัดส่วนการใช้พลังงานเชิงพาณิชย์ขั้นต้นของประเทศไทยและปริมาณการใช้ก๊าซธรรมชาติและถ่านหิน. แหล่งที่มา: <http://www.eppo.go.th/vrs/vrs74.pdf> (10 ม.ค.2550)
- ณวรา สกฤต ณ มรรคา. 2540. ความสามารถในการพยากรณ์ของแบบจำลองการประเมินราคาออร์แกนท์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิติ ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลพงษ์. 2542. “พฤติกรรมการณ์ส่งผ่านราคาทุ้งฤดูการค้าระหว่างตลาดค้าส่งโตเกียวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย” วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ (กันยายน-ธันวาคม): 16-51
- ปฎุฒ ป่านทอง. 2548. การประมาณค่าความผันผวนของราคาหุ้นด้วยวิธีเกาซ์ สำหรับการประเมินค่าราคาใบสำคัญแสดงสิทธิ โดยแบบจำลองแบบดิคและโซลต์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- มหาวิทยาลัยนเรศวร. 2548. พลังงานในปัจจุบัน. แหล่งที่มา: http://www.pyo.nu.ac.th/Info/Term1-49/hp-contest49/1_25/sim.html (15 ม.ค. 2550)
- ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. 2531. การวิเคราะห์อนุกรมเวลา: ตำราประกอบการเรียนวิชาอนุกรมเวลาและเลขดัชนี. มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ มหาสารคาม.

สรนพล วิเชียรรัตนพันธ์. 2547. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการزشเอ็ม:
กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

Baillie, R.T. and Bollerslve, T. 1992. "Prediction in Dynamic Model with Time-Dependent
Condition Variance." **Journal of Economics** 52: 91-113

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

Garcia, Reinaldo; Contreras, Javierb; Van, Akkeren Marko and Batista, Joao. 2003. "GARCH
Forecasting Model to Predict Day-Ahead Electricity Prices." **IEEE Power Systems
Journal** 17: 3-7

Goyal, Amit. 2000. **Predictability of Stock Return Volatility from GARCH Model**.
Available:<http://bus.emory.edu/Agoya/docs/Garch.pdf> (15 December 2006)

Gujarati, Damonar N. 1995. **Basic Econometrics**. 3rd ed. New York: McGraw Hill.

Najand, Mohammad. 2002. "Forecasting Stock Index Future Price Volatility: Linear vs.
Nonlinear Models." **The Financial Review** 37: 93-104

Pindyck, R and Rubinfeld, D. 1998. **Econometric Models and Economic Forecasts**. 4th ed.
New-York: McGraw-Hill

Reuters. 2007. **Reuters Kobra™ Version 3.5.1**. Available: Finance and Investment Center,
Chiang Mai Umiversity, 26 March 2007

Schwert, G.W. 1990. "Stock volatility and crash of 87." **Review of Financial Studies** 3: 77-102

Schwert, G.W. and Seguin, P.J. 1990. "Heteroscedasticity in stock return." **Journal of Finance**
45: 1129-1155

Sharma, Namit. 1998. **Forecasting Oil Price Volatility**. Available: [http://scholar.lib.vt.edu/
theses/available/etd-5398-184344/unrestricted/etd.pdf](http://scholar.lib.vt.edu/theses/available/etd-5398-184344/unrestricted/etd.pdf) (15 December 2006)