

## เอกสารอ้างอิง

- ดำรงศิลป์ ปิยะบงการ. 2548. การพยากรณ์ราคาปาล์มน้ำมันโดยวิธีอาร์มา. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. ความรู้พื้นฐานเกี่ยวกับตลาดเงินและตลาดทุน. กรุงเทพฯ: สถาบันพัฒนาบุคลากรธุรกิจหลักทรัพย์.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. เศรษฐมิตี: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. “พฤติกรรม การส่งผ่านราคา กุ้งกุลาดำ ระหว่าง ตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 33, 3 (กันยายน-ธันวาคม): 16-51.
- นบพงศ์ เอี่ยมไพบุลย์พันธ์. 2547. การส่งผ่านของความผันผวนของอัตราดอกเบี้ยจากประเทศใน ภูมิภาคเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ในช่วงวิกฤตเศรษฐกิจเอเชีย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร มหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- ประทีปสันต์ ต้นเจริญ. 2546. การวิเคราะห์ปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีผลต่อการตัดสินใจลงทุนในตลาด หลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. สารนิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชา เศรษฐศาสตรธุรกิจ มหาวิทยาลัยรามคำแหง.
- วราฤทธิ์ พานิชกิจโกศลกุล. 2545. การเปรียบเทียบการประมาณค่าพารามิเตอร์ของตัวแบบ อนุกรมเวลา. วิทยานิพนธ์สถิตศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- วิภาวี อุบลฉาย. 2546. ปัจจัยทางเศรษฐศาสตรมหภาคที่มีอิทธิพลต่อดัชนีกลุ่ม 50 หลักทรัพย์ของ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วิโรจน์ หวังสมัคร์. 2547. การพยากรณ์ความต้องการใช้ไฟฟ้า กรณีศึกษา: การไฟฟ้าส่วนภูมิภาค เขต 1 ภาคกลาง (พระนครศรีอยุธยา). สารนิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชา เศรษฐศาสตรธุรกิจ มหาวิทยาลัยรามคำแหง.
- ศิริลักษณ์ เล็กสมบุญรณ์. 2531. การวิเคราะห์อนุกรมเวลา. มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ.
- Bollerslev, Tim. 1986. “Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity.” **Journal of Econometrics**. 31: 307-327.
- Enders, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series**. New York: John Willey & Sons.

Gujarati, Damodar N. 2003. **Basic Econometrics**. 4<sup>th</sup> ed. New York: McGraw–Hill  
International.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
Copyright© by Chiang Mai University  
All rights reserved