

เอกสารอ้างอิง

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

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. “พฤติกรรมการณ์การส่งผ่านราคาทุ้งตลาดระหว่าง ตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้ดบรรจู่ในประเทศไทย.” **วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่** 33,3 (กันยายน-ธันวาคม): 16-51. อ้างถึงใน สธนพล วิเชียรรัตนพันธ์. 2547. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการช้เอ็ม: กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่ม พัฒนาอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

สธนพล วิเชียรรัตนพันธ์. 2547. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการช้เอ็ม: กรณีศึกษา หลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

จิตติ ต้นเสณีย์. 2548. การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์ราคาหลักทรัพย์ระหว่าง แบบจำลองนิเวรอลเน็ตเวิร์ค กับ แบบจำลองอาร์มาและอีการช้เอ็ม. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ทรงศิริ เต้สมบัติ. 2539. **เทคนิคการพยากรณ์เชิงปริมาณ**. กรุงเทพฯ: ฟิสิกส์เซนเตอร์.

นริสา สมุทรสาคร. 2547. การพยากรณ์ราคาทองคำโดยวิธีอาร์มา. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ภัทร์ ตั้งตระกูล. 2546. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการช้เอ็ม: กรณีศึกษา หลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุก่อสร้างและตกแต่ง. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์ มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ราชพล สุนทรศรี. 2548. การพยากรณ์ราคาน้ำมันดิบโดยวิธีอาร์มา. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

Bollerslev, Tim. "Generalized Autoregressive Condition Heteroscedasticity." *Journal of Econometrics* 31(1986): 307-327.

Dickey, D.A., and W.A. Fuller. 1981. "Likelihood Ratio Statistic for Autoregressive time Series with a Unit Root." *Econometrica* 49. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์**. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

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

Engle, R.F.; Lilien, D and Robins, R.P. "Estimating Time Varying Risk Premia in the Term Structure: The ARCH-M model." *Econometrica* 55 (1987): 391-407.

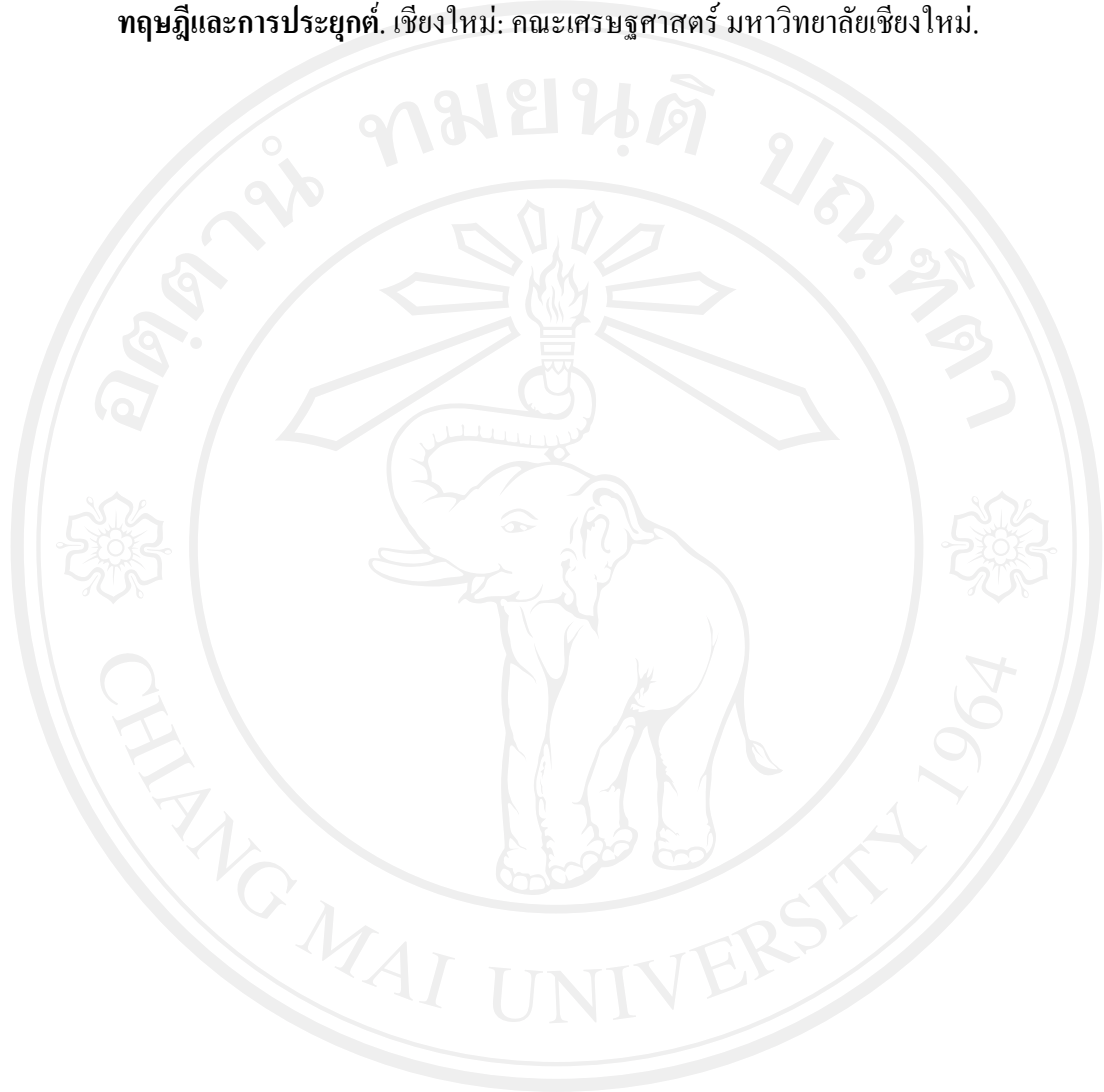
Gujarati, D. 1995. *Basic Econometrics*. 3rd ed. New York: MacGraw-Hill.

Matteo Manera, McAleer, M. and Grasso, Margherita. 2004. **Modelling Dynamic Conditional Correlations in the Volatility of Spot and Forward Oil Price Returns**. Paper Department of Statistics, University of Milan-Bicocca and FEEM, Milan, Italy, School of Economics and Commerce, University of Western Australia, FEEM, Milan, Italy.

McAleer, M., Chan, F. and Marinova, D. 2002. "An econometric analysis of asymmetric volatility: Theory and application to patents." *Journal of Econometrics* Paper presented to the Australasian meeting of the Econometric Society, Brisbane, Australia, (July).

McAleer, M., Hoti, S., and Chab, F. 2009. "Structure and asymptotic theory for multivariate asymmetric conditional volatility." *Econometric Reviews* 28: 422-440.

Said, S. and Dickey, D. 1984. "Testing for Unit Roots in Autoregressive-Moving Average Models with Unknown Order." *Biometrics* 71. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์**. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved