

เอกสารอ้างอิง

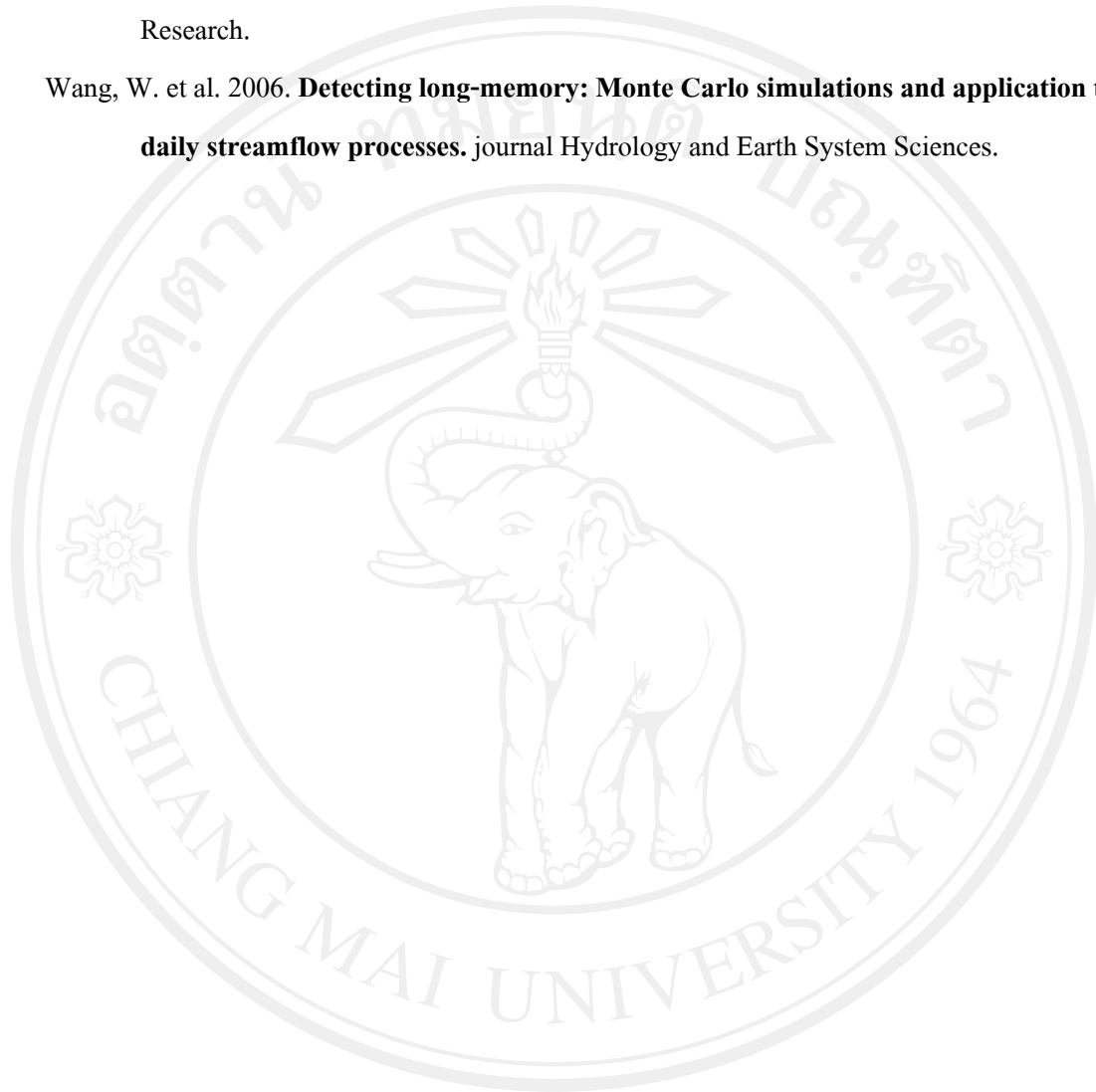
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2543. การลงทุน. กรุงเทพฯ : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ชุตินิธิ์ พรหมชาติแก้ว. 2548. ประสิทธิภาพของการวิเคราะห์ทางเทคนิคในการพยากรณ์ราคาหุ้น
กลุ่มอาหารและเครื่องดื่มและกลุ่มบันเทิงและสันทนาการ. การค้นคว้าแบบอิสระ
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ณัฐนรีย์ มลคณเกิด. 2553. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลกระทบต่อผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่ม
ธุรกิจอาหารและเครื่องดื่มในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยสมการถดถอยกำลังสอง
น้อยที่สุดที่ตัดแต่งค่าคลาดเคลื่อน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- นรเศรษฐ ศรีธานี. 2551. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนจากการลงทุนใน
หลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ด้วยเทคนิค Value at Risk (VaR).
รายงานการวิจัยวิทยาลัยนอร์ทกรุงเทพ.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตติ: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่ : คณะเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลพงษ์. 2542. “พฤติกรรมการส่งผ่านราคาหุ้นในตลาด
ค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย” วสารเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ (กันยายน-ธันวาคม): 16-51.
- ทรูปlookปัญญา. 2552. ระบบเศรษฐกิจไทย. แหล่งที่มา :
http://www.trueplookpanya.com/true/knowledge_detail.php?mul_content_id=1336 (20
กรกฎาคม 2554)
- ไทยแลนด์ซีเคียวริทีอินสติทิว. เงินทองต้องใส่ใจ. แหล่งที่มา :
http://www.bla.co.th/blasite/TH/investor_PF/Personal_Fin/risk&Return/risk5_final/risk5.html (5
กรกฎาคม 2554)
- เพ็ญพิมล ลีโนทัย. การเงินธุรกิจ. แหล่งที่มา : <http://courseware.rmutl.ac.th/courses/60/unit000.htm>
(5 กรกฎาคม 2554)

- เริงชัย ต้นสุชาติ. 2553. เอกสารคำสอนวิชา ศศ 423 เศรษฐมิติของอนุกรมเวลาและการพยากรณ์
ทางเศรษฐกิจ. คณะเศรษฐศาสตร์, มหาวิทยาลัยแม่โจ้
- โรเบิร์ต อีเกิล. 2551. เหตุใดตลาดการเงินจึงมีความผันผวนสูง.
แหล่งที่มา : <http://www.ryt9.com/s/prg/484342> (5 กรกฎาคม 2554)
- วิชาญ ปัสพงษ์. 2551. ตลาดการเงิน. แหล่งที่มา :
<http://www.learners.in.th/blog/charm3029/153925> (5 กรกฎาคม 2554)
- ศิริประภา พรเจริญ. 2548. การทดสอบแบบจำลองฟาร์มาและเฟรนช์กับหลักทรัพย์กลุ่มอาหารและ
เครื่องดื่ม ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร-
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. 2531. การวิเคราะห์อนุกรมเวลา. มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์
มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ.
- สถณี อาชนันทกุล. 2552. การพัฒนาตลาดการเงินเพื่อความเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจ.
แหล่งที่มา: http://www.tdri.or.th/ye_08/papers/disclosure-summary-1.doc (10 กรกฎาคม
2554)
- สำนักงานเศรษฐกิจการเกษตร. 2552. สถิติการค้าสินค้าเกษตรไทยกับต่างประเทศ. แหล่งที่มา:
<http://www.oae.go.th/download/journal/trade%20statistics52.pdf> (30 ตุลาคม 2554)
- อภิรักษ์ ชัยสุวรรณรักษ์. 2549. ปัจจัยที่มีผลกระทบต่อราคาหลักทรัพย์กลุ่มอาหารและเครื่องดื่ม
ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อัจฉราภรณ์ อินก้อนวงศ์. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นกลุ่มอาหารและเครื่องดื่มบางหุ้น
โดยวิธีการถดถอยสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- 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.
- Bollerslev, T. 1986. **Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity.**
J. Econometrics 31 ,pp307–327.
- Bollerslev, T. and H. O. Mikkelsen. 1996. **Modeling and Pricing Long-Memory in Stock
Market Volatility.** Journal of Econometrics, 73, 151–184.

- 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
- Chokethaworn, K. 2010. **INTERNATIONAL TOURIST ARRIVALS IN THAILAND: FORECASTING WITH ARFIMA-FIGARCH APPROACH**. Annals of the University of Petroşani, Economics, 10(2), 2010, 75-84.
- Christensen, B.; Nielsen, M. and Zhu, J. 2007. **Long Memory in Stock Market Volatility and the Volatility-in-Mean Effect: The FIGARCH-M Model**. University of AARHUS.
- Enders, W. 1995. **Applied Econometric Time Series**. New York : John Wiley & Sons. Inc.
- Engle, R. 1982. **Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimates of the Variance of the United Kingdom Inflation**. Econometrica 50 ,pp987-1008.
- Granger, C.W.J. and Newbold, P. 1974. **Spurious Regression in Econometrics**. J.Econometrics 2,pp111-120.
- Granger, C. W. J. and Joyeux, R. **An introduction to long memory time series models and fractional differencing**. Journal of Time Series Analysis 1, 1980: 15-29.
- Hamilton, D. 1994. **Time series analysis**. Princeton: Princeton University Press.
- Hosking, J. 1981. **Fractional differencing**. Biometrika 68, 1981: 165-176.
- Hurt, H. E. 1951. **Long Term Storage Capacity of Reservoirs**. Transactions of the American Society of Civil Engineers 116: 770-799.
- Ipredict. 2004. **Time-series Forecasting Error Statistics**.
Available: <http://www.ipredict.it/ErrorStatistics.aspx> (July 05, 2011)
- Koopman, S.; Ooms, M. and Carnero, M. 2005. **Periodic seasonal Reg-ARFIMA-GARCH models for daily electricity spot prices**. Tinbergen Institute Amsterdam.
- Korkmaz, T. 2009. **Testing for Long Memory in ISE Using ARFIMA-FIGARCH Model and Structural Break Test**. Turkey: Zonguldak Karaelmas University.
- Nelson, D. B. 1991. **Conditional heteroskedasticity in asset returns: A new approach**. Econometrica 59, 347-370.

Swanson, A.; Tayman, J. and Bryan, T. 2011. **MAPE-R: A RESCALED MEASURE OF ACCURACY FOR CROSS-SECTIONAL FORECASTS.** Journal of Population Research.

Wang, W. et al. 2006. **Detecting long-memory: Monte Carlo simulations and application to daily streamflow processes.** journal Hydrology and Earth System Sciences.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

ประวัติผู้เขียน

ชื่อ-สกุล	นายปรีวัตร ยอดผ่านเมือง
วัน เดือน ปี เกิด	8 ธันวาคม 2530
ประวัติการศึกษา	สำเร็จการศึกษาระดับมัธยมศึกษา โรงเรียนสามัคคีวิทยา ปีการศึกษา 2548 สำเร็จการศึกษาระดับปริญญาตรี บริหารธุรกิจบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ ปีการศึกษา 2553

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved