

## เอกสารอ้างอิง

ผจงจิต ดิบบประสอน. ผลกระทบของการบริโภคพลังงานต่อการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของ

ประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2551.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. “พฤติกรรมการณ์ส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดค้าส่ง

โตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 33, 3 (กันยายน-ธันวาคม 2542): 16-51.

วราพงษ์ วงศ์วัชร. **Observable Regime-switching Models for SET Returns.** [Online].

Available: <http://utcc2.utcc.ac.th/academicweek/economic/%E0%B8%A7%E0%B8%A3>

[/E0%B8%B2%E0%B8%9E%E0%B8%87%E0%B8%A8%E0%B9%8C.pdf](http://utcc2.utcc.ac.th/academicweek/economic/%E0%B8%A7%E0%B8%A3%E0%B8%B2%E0%B8%9E%E0%B8%87%E0%B8%A8%E0%B9%8C.pdf)

(May 1, 2009).

Afonso, A. and Teixeira, J. **Non-linear tests of weakly efficient markets: Evidence from**

**Portugal.** [Online]. Available: [http://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract\\_id=](http://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract_id=704902)

704902 (May 1, 2009).

Benbouziane, M. and Benamar, A. **The Purchasing Power Parity in The Maghreb Countries:**

**A Nonlinear Perspective.** [Online]. Available: <http://mpr.ub.uni-muenchen.de/13853>

(May 18, 2009).

Cuaresma, J. C. **Forecasting European GDP Using Self-Exciting Threshold**

**Autoregressive Models: A Warning.** [Online]. Available:

<http://www.ihs.ac.at/publications/eco/es-79.pdf> (May 18, 2009).

Ender, W. **Applied Econometrics Time Series.** New York: John Wiley & Sons, 1995.

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

Hansen, B. E. **Inference in TAR Models.** [Online]. Available: [http://escholarship.bc.edu/cgi/](http://escholarship.bc.edu/cgi/viewcontent.cgi?article=1309&context=econ_papers)

[viewcontent.cgi?article=1309&context=econ\\_papers](http://escholarship.bc.edu/cgi/viewcontent.cgi?article=1309&context=econ_papers) (June 1, 2009).

Hansen, B. E. **Sample Splitting and Threshold Estimation.** [Online]. Available:

[www.ssc.wisc.edu/~bhansen/papers/ecnmt\\_00.pdf](http://www.ssc.wisc.edu/~bhansen/papers/ecnmt_00.pdf) (June 1, 2009).

Johansson, M. W. **TAR models and real exchange rates.** [Online]. Available:

[http://www.nek.lu.se/publications/workpap/Papers/WP01\\_21.pdf](http://www.nek.lu.se/publications/workpap/Papers/WP01_21.pdf) (June 1, 2009).

Kuo, B. S. and Mikkola, A. **Forecasting the Real US/DEM Exchange Rate: TAR vs. AR.**

[Online]. Available: [http://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract\\_id=1021170](http://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract_id=1021170)

(April 1, 2009).

Posedel, P. and Tica, J. **Threshold Autoregressive Model of Exchange Rate Pass**

**Through Effect : The Case of Croatia.** University of Zagreb WORKING PAPER

SERIES No. 07-15, 2007.

Potter, S. M. **Nonlinear Time Series Modelling: An Introduction.** [Online].

Available: [http://www.newyorkfed.org/research/staff\\_reports/sr87.pdf](http://www.newyorkfed.org/research/staff_reports/sr87.pdf)

(April 1, 2009).

Ramsey, J. B. **Tests for Specification Errors in Classical Linear Least-Squares Regression**

**Analysis.** Journal of the Royal Statistical Society. Series B (Methodological), Vol. 31,

No. 2. (1969), pp. 350-371.

Van Gelder L. and Stokman A. **Regime transplants in GDP growth forecasting: A recipe for**

**better predictions?** [Online]. Available: [http://www.dnb.nl/en/binaries/Working%20](http://www.dnb.nl/en/binaries/Working%20Paper%20No%2E%20106-2006_tcm47-146763.pdf)

[Paper%20No%2E%20106-2006\\_tcm47-146763.pdf](http://www.dnb.nl/en/binaries/Working%20Paper%20No%2E%20106-2006_tcm47-146763.pdf) (April 1, 2009).