

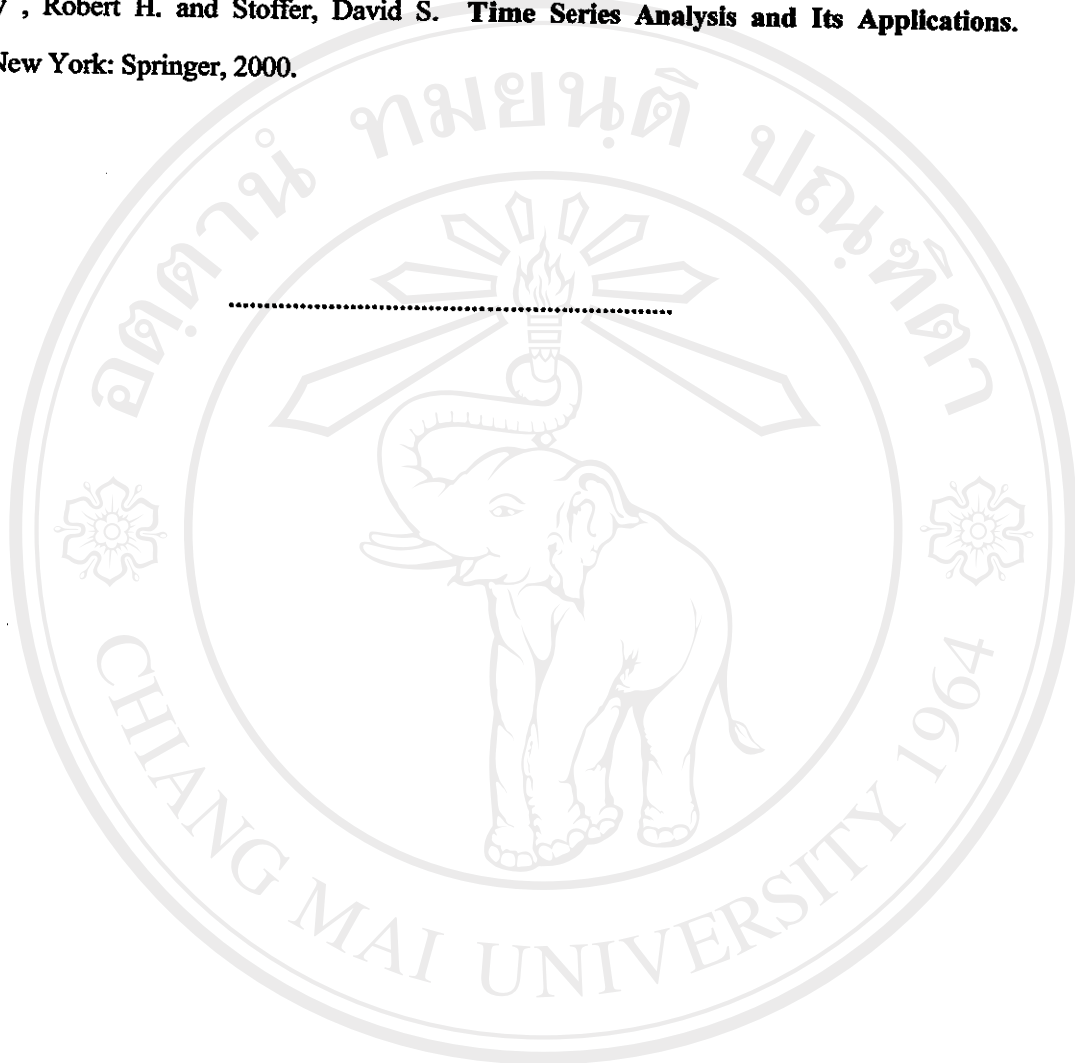
เอกสารอ้างอิง

- จิตรพรพรรณ ใจคุ้ม. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- เจน ประสิทธิ์ล้ำค่า. พฤติกรรมการเคลื่อนไหวของราคาหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2526.
- ชัย โกรกิจสุวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- ถนอมศรี ฟ่องอรุณรุ่ง. การทดสอบระดับความผันผวนของหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2537.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. “พฤติกรรมการส่งผ่านราคาหุ้นอุตสาหกรรมในตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิตเชียงใหม่ 33, 3 (กันยายน-ธันวาคม 2542): 16-51.
- นฤมล เขาวนวิทย์. ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนในตลาดแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศกับตลาดหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2542.
- บริษัทหลักทรัพย์กิมเิ่ง(ประเทศไทย) จำกัด. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.kimeng.co.th> 14 มีนาคม 2546.
- พัชรกรณณ์ คงเจริญ. หน่วยลงทุนในประเทศไทย อัตราผลตอบแทน ความเสี่ยง และกลยุทธ์การลงทุน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2535.
- พิกุล แซ่โล้ว. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มหุ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- ภัทร์ ตั้งตระกูล. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเื่อม: กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุก่อสร้างและตกแต่ง การค้นคว้าอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2545.
- มุกดา แม่นมินทร์. อนุกรมเวลาและการพยากรณ์. กรุงเทพฯ: คณะวิทยาศาสตร์และเทคโนโลยี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

- ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. การวิเคราะห์อนุกรมเวลา: ตำราประกอบการเรียนวิชาอนุกรมเวลาและ
เลขคี่. มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ มหาสารคาม,
2531.
- สุนทร สุกันทา. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ธุรกิจเกษตรในตลาดหลักทรัพย์แห่ง
ประเทศไทยโดยวิธีโคโรนิกิเกรชัน การค้นคว้าอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์. บริษัทที่ออกหลักทรัพย์.
[ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.sec.or.th/corp-fin/cgi-bin/find69.php>. 14 มีนาคม
2546.
- Baillie, R.T. and Bollerslev, T. "Prediction in Dynamic Models with Time-Dependent
Conditional Variances." *Journal of Econometrics* 52 (1992): 91-113.
- Brailsford, Timothy. "Market Closures and Time-Varying Volatility in the Australian Equity
Market." *Journal of Empirical Finance* 2 (1995): 165-172
- Choudhry, Taufiq. "Stock Market Volatility and the Crash of 1987: Evidence from Six Emerging
Markets." *Journal of International Money and Finance* 15, 6 (1996): 969-981.
- Devaney, Michael. "Time Varying Risk Premia for Real Estate Investment Trusts: A GARCH-M
Model." *The Quarterly Review of Economics and Finance* 41 (2001): 335-346
- Enders, Walter. *Applied Econometric Time Series*. New York: John Wiley & Sons, 1995.
- 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.
- Goyal, Amit. 2000. **Predictability of Stock Return Volatility from GARCH Models**.
[Online]. Available: <http://www.bus.emory.edu/Agoyal/docs/Garch.pdf>. 2 March 2003.
- Ito, Akitoshi. "Profits on Technical Trading Rules and Time-Varying Expected Returns:
Evidence from Pacific-Basin Equity Markets." *Pacific-Basin Finance Journal* 7(1999):
283-330.
- Karanasos, Menelaos. **Prediction in ARMA models with GARCH in Mean Effects**. [Online].
Available: <http://ideas.repec.org/p/yor/yorken/99-11.html>. 2 March 2003.
- Pindyck, Robert S. and Rubinfeld, Daniel L. **Econometric Models and Economic Forecasts**,
4th ed. New York: McGraw-Hill International, 1997.

Reuters. 2004. Reuters Kobra™ version 3.5.1. [Online]. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 30 May 2004.

Shumway , Robert H. and Stoffer, David S. **Time Series Analysis and Its Applications.** New York: Springer, 2000.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved