

เอกสารอ้างอิง

- กมล สักกะโต. 2547. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มขนส่งด้วยวิธีการเส้นพรมแดนเชิงเส้น. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2540. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
- ชัยโย กรกิจสุวรรณ. 2540. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารีย์ วิบูลย์พงษ์. 2542. “พฤติกรรม การส่งผ่านราคา กุ้งกุลาดำ ระหว่างตลาดค้าส่งโตเกียวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 33, 3 (กันยายน-ธันวาคม): 16-51
- ปาริฉัตร รัตนพัวพันธ์. 2547. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม ในหลักทรัพย์กลุ่มพลังงาน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ภัทร์ ตั้งตระกูล. 2546. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม ในกลุ่มหลักทรัพย์วัสดุก่อสร้างและตกแต่ง. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เยาวลักษณ์ จันทร์ดี. 2547. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม ในหลักทรัพย์กลุ่มสื่อสาร. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ศิริลักษณ์ เล็กสมบุญ. 2531. การวิเคราะห์อนุกรมเวลา: ตำราประกอบการเรียนวิชาอนุกรมเวลา เลขดัชนี. มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒมหาสารคาม.

สรนพล วิเชียรรัตน์พันธ์. 2547. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็มใน
หลักทรัพย์กลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

Bollerslev, Tim. 1986. "Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity." **Journal of Econometrics** 31: 307-32

Brailsford, Timothy. 1995. "Market Closures and Time-Varying Volatility in the Australian Equity Market." **Journal of Empirical Finance** 2: 165-17

Enders, Walter. 1995. **Applied Econonmic Time series**. New York: John Wiley & Son.

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

Goyal, Amit. 2000. **Predictability of Stock Return Volatility from GARCH Model**.
Available: <http://www.bus.emory.edu/Agoya/docs/Garch.pdf>. (26 February 2007)

Reuters. 2007. **Reuters Kobra™ Version 3.5.1**. Available: Finance and Investment Center,
Chiang Mai University. 2 March 2007

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved