

เอกสารอ้างอิง

- ชิดชนก วงษ์เครือ. 2547. การพยากรณ์ดัชนีราคาวัสดุก่อสร้างโดยวิธีอาร์มา. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิติ ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2545. เศรษฐมิติ: เอกสารประกอบการสอน. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. “พฤติกรรมการณ์ส่งผ่านราคาทุเรียนในตลาดค้าส่งโตเกียวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย” วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ (กันยายน-ธันวาคม): 16-51
- ชนัยวงศ์ กิรติวานิชย์. 2547. ฐิติวิเคราะห์เจาะเรื่องกองทุนรวม. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- ปฤถ ป่านทอง. 2548. การประมาณค่าความผันผวนของราคาหุ้นด้วยวิธีการช สำหรับการประเมินค่าราคาใบสำคัญแสดงสิทธิโดยแบบจำลองแบล็คและโซลส์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- ปิยนุช เรืองขจร. 2550. การประมาณค่าความผันผวนของผลตอบแทนของราคาน้ำมันดิบ ถ่านหิน และก๊าซธรรมชาติ โดยวิธี อาร์มาอีการ์ช อาร์มาการ์ชเอ็มและอาร์มาการ์ช. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- พิเชษฐ โพธิ์จรรยากุล. 2545. ศึกษาความเสี่ยงและผลตอบแทนของกองทุนรวมในประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ภวิษฐ์พร วงศ์ศักดิ์. 2549. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของกองทุนรวมที่ลงทุนในต่างประเทศ. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ยุวดี คันทะมูล. 2548. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคา และปริมาณของหลักทรัพย์ กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

วรัณญา นวะมะรัตน์. 2550. การวิเคราะห์อัตราผลตอบแทน ความเสี่ยง และ ความสามารถในการบริหารหลักทรัพย์ของกองทุนรวม. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. 2531. การวิเคราะห์อนุกรมเวลา: ตำราประกอบการเรียนวิชาอนุกรมเวลา และเลขดัชนี. มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ มหาสารคาม.

ศชนพล วิเชียรรัตน์พันธ์. 2547. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม: กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มอสังหาริมทรัพย์. แบบฝึกหัดการวิจัยกระบวนวิชา 751409 คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตินทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

สมาคมบริษัทจัดการลงทุน. ข้อมูลของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ (NAV)และดัชนีตลาดหลักทรัพย์(Set Index). แหล่งที่มา: <http://www.nesdb.go.th> (23 กุมภาพันธ์ 2551).

สุวรรณ วลัยเสถียร. 2550. ลงทุนให้มั่งคั่ง. กรุงเทพฯ: อักษรไทย

Box, G. and Jenkins, G. 1976. **Time series analysis; forecasting and control**. SanFranciso: Holden Day.

Enders, Walter. 1995. **Applied econometrics time series**. New York: John Wiley & Sons.

Engle and Bollerslev, Tim. 1986. "Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity." **Journal of Econometrics** 31: 307-327.

Engle, R. 1982. "Autoregressive conditional heteroscedasticity with estimates of the variance of the United Kingdom inflation." **Econometrica** 50: 987-1008.

Goyal, Amit. 2000. **Predictability of stock return volatility from GARCH models**.

Available: <http://bus.emory.edu/Agoya/docs/Garch.pdf> (December 15, 2004)

Granger, G.W.J. 1969. "Investigating causality relations by econometric models and gross spectral methods." **Econometrica** (July): 424-438.

Granger, G.W.J. and Newbold, P. 1974. "Spurious regression in econometrics." **Journal of Econometrics** 2: 111-120.

Nelson, Daniel B., 1991. "Conditional Heteroskedasticity in Asset Returns: a new approach" **Econometrica** 59, 2: 347-370.

Wold. 1938. **Theorems on time series**. Available: <http://www.jstor.org> (February 17, 2008)