

เอกสารอ้างอิง

- กระทรวงคมนาคม. ปริมาณน้ำมันที่ใช้ในการคมนาคมขนส่ง แยกตามประเภทการขนส่ง. [ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา <http://www.news.mot.go.th/motc/portal/graph/excel/index20.asp>
- โกสินทร์ อาศิรวณะ. 2549. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ของผลตอบแทนระหว่างหุ้นสามัญกับวอร์เรนที่ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ณัฐพงษ์ อภินันท์กุล. กลยุทธ์การลงทุนในความผันผวน (Core & Satellite Strategy). [ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา: http://guru.sanook.com/pedia/topic/Core_%7C12%7C_Satellite_Strategy
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2552. กราฟราคาดัชนีย้อนหลัง. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th/th/market/setindexchart.html> (23 พฤษภาคม 2552)
- _____. 2548. คำศัพท์หุ้นน่ารู้. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิติ ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตรมหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลพงษ์. 2542. “พฤติกรรม การส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย” วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ (กันยายน-ธันวาคม): 16-51.
- น้ำริน ผลไสว. 2550. การวิเคราะห์ความผันผวนของอัตราผลตอบแทนของดัชนีราคาหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ไทย สิงคโปร์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปภูล ปานทอง. 2548. การประเมินค่าความผันผวนของราคาหุ้นด้วยวิธีการสำหรับการประเมินค่าราคาใบสำคัญแสดงสิทธิ โดยแบบจำลองแบล็คและโซลส์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปฎิภาณ สุริยะโชติ. 2549. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นกลุ่มธนาคารของประเทศไทยกับดัชนีราคาหุ้นกลุ่มธนาคารต่างประเทศในเอเชีย . การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- พรกมล ปัญจะธง. 2548. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการช่อ้มของหุ้นในกลุ่ม
 ขนส่ง. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วรลักษณ์ ชมพูพงษ์. 2548. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณของหลักทรัพย์
 กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน.
 การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สุดารัตน์ สุทธาวาสสุนทร. 2548. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณการซื้อขาย
 หลักทรัพย์ในกลุ่มบันเทิงและสันทนาการของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธี
 โคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัย
 เชียงใหม่.
- อยุธยา จำกัด. กระจายความเสี่ยงโดยการลงทุนในต่างประเทศ ดร.ฐนิตพงศ์ ชื่นภิบาล ผู้ช่วย
 ผู้อำนวยการฝ่ายควบคุมความเสี่ยง บลจ.อยุธยาจำกัด ดีพิมพีในนสพ. ผู้จัดการรายวัน
 ฉบับวันที่ 11 กันยายน 2551 [ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา: [http://www.ajffunds.com/
 ArticleDetAil.aspx?id=550&lang=T](http://www.ajffunds.com/ArticleDetAil.aspx?id=550&lang=T)
- Black, F. 1976. "Studies of stock price volatility changes, Proceedings of the American
 Statistical Association." **Business and Economic Statistics Section** p. 177-181.
- Bollerslev, Tim. 1986. "Generalized autoregressive conditional heteroskedasticity." **Journal of
 Econometrics** 31: 307-327.
- Engle, R. F., Lilien, D. M. and Robins, R. P. 1987. "Estimating time-varying risk premia in the
 term structure: The ARCH-M Model." **Econometrica** 55: 391-408.
- "Energy Statistics from the U.S. Government" **Petroleum Navigator**. [Online] Available:
<http://tonto.eia.doe.gov/dnav/pet/hist/rwtcM.htm>
- Granger, C.W.J. 1969. "Investigating causality relations by econometric models and cross-
 spectral methods" **Econometrica** (July): 424-438
- Nelson, Daniel B.. 1991. "Conditional heteroskedasticity in asset returns: a new approach"
Econometrica 59, 2: 347-370.
- Rahman, M. and Mustafa, M. 1997 "Dynamics of real exports and real economic growths in 13
 selected Asian countries." **Journal of Economic Development** (22 December) : 81-84