

เอกสารอ้างอิง

จิตติ ต้นเสนีย์. 2549. การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์ราคาหลักทรัพย์ระหว่างแบบจำลองนิเวศเน็ตเวิร์คกับแบบจำลองอาร์มาและอีการ์ชเอ็ม. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2552. เงินลงทุนโดยตรงสุทธิจากต่างประเทศในปี 2550-2551 จำแนกตามสาขาการลงทุน. [ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา:

www.boi.go.th/thai/download/investment_foreign/123/FDI08.pdf. (28 มกราคม 2552).

ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2552. เงินลงทุนโดยตรงสุทธิจากต่างประเทศในปี 2550-2551 จำแนกตามแหล่งที่มา. [ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา:

www.boi.go.th/thai/download/investment_foreign/123/FDI08.pdf. (28 มกราคม 2552).

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2551. ดัชนีและมูลค่าตามราคาตลาดปรับตัวตามสถานการณ์เศรษฐกิจ. [ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา: www.set.or.th. (28 มกราคม 2552).

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2551. ภาพรวมตลาดลงทุนไทยปี 2551. [ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา: www.set.or.th. (28 มกราคม 2552).

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตี : ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. “พฤติกรรมการณ์ส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดระหว่างตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 3: 16-51.

วิชญ์ตรี วิษย์รัตน์. 2548. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ในภูมิภาคเอเชีย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

พริ้มรวี สมงาม. 2546. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ในภูมิภาคเอเชีย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

พรกมล ปัญจะธง. 2549. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเื่อมของหุ้นในกลุ่มขนส่ง. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

สธนพล วิเชียรรัตนพันธ์. 2547. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลอง GARCH-M : กรณีศึกษาหลักทรัพย์กลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

สร้อยสุดา เรืององอาจ. 2551. การวิเคราะห์อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงในการลงทุนของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต สาขาเศรษฐศาสตรการุ้จัดการ มหาวิทยาลัยศรีนรินทรวิโรฒ.

อัญญา ชันชวิทย์. 2547. การวิเคราะห์ความเสี่ยงจากการลงทุนในหลักทรัพย์. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

Adrangi, B., Chatrath, A. and Raffiee, K. 1999. "Volatility characteristics and persistence in Latin American emerging markets" **International Journal of Business** 4(1): 19-37.

Aggarwal, R., Inclan, C. and Leal, R. 1999. "Volatility in emerging stock markets" **Journal of Financial and Quantitative Analysis** 34(1): 33-55.

Bollerslev, T. 1986. "Generalized autoregressive conditional heteroskedasticity." **Journal of Econometrics** 31: 307-327.

Choudhry, Taufio. 2000. "Day of the week effect in emerging Asian stock markets: evidence from the GARCH model" **Applied Financial Economics** p.235-242.

Engle, R.F.. 2000. "Dynamic conditional correlation a simple class of multivariate GARCH models." **Review of Financial Economic**. [Online]. Available: [http:// www.sciencedirect.com](http://www.sciencedirect.com). (February 1, 2009).

Engle, R.F. and Granger, C.W.J. 1987. "Co-integration and error correction : representation, estimation, and testing." **Econometrica** 55: 251-276.

Fernández-Izquierd, Angeles and Lafuente, Juan Angel. 2004. "International transmission of stock exchange volatility, Empirical evidence from the Asian crisis." **Global Finance Journal** 15(2): 125-137.

Fountas, Kalanassos, and Kim. 2001. **Inflation and output growth uncertainty and their relationship with inflation and output growth**. Ireland: Department of Economics, National University of Ireland.

Greene, William H.. 2003. **Econometric analysis**. 5th ed. New York: Macmillan.

Reuters. 2009. **Reuters Kobra 3.5.1**. [Online]. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University, February 2, 2009.

Tsay, Ruey S. 2005. **Analysis of financial time series**. 2nd ed. New York: John Wiley & Sons.