

เอกสารอ้างอิง

- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย .2553.การซื้อขายแยกตามกลุ่มผู้ลงทุน.แหล่งที่มา :
http://www.setsmart.com/ism/ism_customertype.jsp 20 พฤษภาคม 2553.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์.2547. เศรษฐมิติ:ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ประไพศรี ทิพย์แก้ว.2552.การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ของความผันผวนระหว่างอัตราผลตอบแทนดัชนีหุ้นกลุ่มพลังงาน และกลุ่มขนส่งในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิตมหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ภาณุรณ นัตรชัยการ.2551.การประมาณค่าความผันผวนและพยากรณ์มูลค่ากองทุนเพื่อการเลี้ยงชีพ และกองทุนหุ้นระยะยาวโดยใช้แบบจำลองอาร์มา-การ์ช และอาร์มา-อีการ์ช .การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิตมหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วิญญูเดช นันไชยแก้ว.2552.การวิเคราะห์ความผันผวนของดัชนีตลาดหลักทรัพย์ในกลุ่มประเทศG7.การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิตมหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อนุสร ต่ายหัวดง.2551.การประมาณค่าความผันผวนสำหรับผลตอบแทนของดัชนีกลุ่ม 50 หลักทรัพย์ ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยใช้แบบจำลองอาร์มา-การ์ช .การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิตมหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Alexander, C.O. 2001. "Orthogonal GARCH." Alexander, C.O. (ed.), **Mastering Risk 2** : 21–38.
- Bollerslev, Tim. 1986. "Generalized autoregressive condition heteroscedasticity." **Journal of Econometrics** 31: 307-327.
- Bollerslev, T. 1990. "Modelling the coherence in short-run nominal exchange rate: A multivariate generalized ARCH approach." **Review of Economics and Statistics** 72:498-505
- Bollerslev, T., and Mikkelsen, H. O. 1996. "Modeling and pricing long memory in stock market volatility" **Journal of Econometrics** 73, 151-184.
- Bollerslev, T and Wooldridge, J.M. 1992. "Quasimaximum likelihood estimation and inference in dynamic models with time-varying covariances." **Econometric Reviews** 11 : 143-173.
- Bollerslev, T; Engle, R and Wooldridge, J. 1988. "A capital asset pricing model with timevarying covariances." **Journal of Political Economy** 96 (1) : 116-131.

Box, G. and Jenkins, G. 1976. **Time series analysis; forecasting and control.**

SanFranciso:Holden Day.

Dickey, D.A., and Fuller, W.A.. 1981. "Likelihood ratio statistic for autoregressive time series with a unit root." **Econometrica** 49.

Edward, Sebastian. 1998. "Interest rate volatility, contagion and convergence : an empirical investigation of the cases of Argentina, Chile and Mexico." **Journal of Applied Economics** 1 (November) : 55-86

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

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

Said, S. and Dickey, D. 1984. "Testing for unit roots in autoregressive-moving average models with unknown order." **Biometrics** 71.

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