บรรณานุกรม

"เงาหุ้น." 2546. **ไทยรัฐ** (8 พฤษภาคม): 9.

เจน ประสิทธิ์ล้ำค่า. **พฤติกรรมการเคลื่อนไหวของราคาหลักทรัพย์.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2526.

ชัยโย กรกิจสุวรรณ. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.

"ตารางหุ้น." 2546. **กรุงเทพธุรกิจ** (17 มีนาคม): 27

ถนอมศรี ฟองอรุณรุ่ง. **การทดสอบระดับความผันผวนของหลักทรัพย์.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2537.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. "พฤติกรรมการส่งผ่านราคากุ้งกุลาดำระหว่างตลาดค้าส่งโตเกียวกับตลาดผู้คัดบรรจุในประเทศไทย." **วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่** 33, 3 (กันยายน-ธันวาคม 2542): 16-51.

นฤมล เชาวน์วิทยางกูร. **ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนในตลาดแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศกับตลาดหลักทรัพย์.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2542.

บริษัทหลักทรัพย์กิมเอ็ง (ประเทศไทย) จำกัด. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: http://www.kimeng.co.th/thai/index.asp. 14 มีนาคม 2546.

พัชราภรณ์ คงเจริญ. **หน่วยลงทุนในประเทศไทย อัตราผลตอบแทน ความเสี่ยง และกลยุทธ์การลงทุน.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2535.

พิกุล แซ่โล้ว. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.

ไพบูลย์ ราชนิยม. ผู้จัดการฝ่ายอาวุโส บล. เอบีเอ็น แอมโร เอเซีย จำกัด(มหาชน). 2546. สัมภาษณ์. 28 พฤษภาคม 2546.

มุกดา แม้นมินทร์. **อนุกรมเวลาและการพยากรณ์.** กรุงเทพฯ: คณะวิทยาศาสตร์และเทคโนโลยี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. **การวิเคราะห์อนุกรมเวลา: ตำราประกอบการเรียนวิชาอนุกรมเวลาและเลขดัชนี.** มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ มหาสารคาม, 2531.

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์. **บริษัทที่ออกหลักทรัพย์.** [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: http://www.sec.or.th/corp-fin/cgi-bin/find69.php. 14 มีนาคม 2546.

Baillie, R.T. and Bollerslev, T. "Prediction in Dynamic Models with Time-Dependent Conditional Variances." **Journal of Econometrics** 52 (1992): 91-113.

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

Brailsford, Timothy. "Market Closures and Time-Varying Volatility in the Australian Equity Market." **Journal of Empirical Finance** 2 (1995): 165-172

Choudhry, Taufiq. "Stock Market Volatility and the Crash of 1987: Evidence from Six Emerging Markets." **Journal of International Money and Finance** 15, 6 (1996): 969-981.

Devaney, Michael. "Time Varying Risk Premia for Real Estate Investment Trusts: A GARCH-M Model." **The Quarterly Review of Economics and Finance** 41 (2001): 335-346

Enders, Walter. **Applied Econometric Time Series.** New York: John Wiley & Sons, 1995.

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

Goyal, Amit. 2000. **Predictability of Stock Return Volatility from GARCH Models.** [Online]. Available: http://www.bus.emory.edu/Agoyal/docs/Garch.pdf. 2 March 2003.

Ito, Akitoshi. "Profits on Technical Trading Rules and Time-Varying Expected Returns: Evidence from Pacific-Basin Equity Markets." **Pacific-Basin Finance Journal** 7(1999): 283-330.

Karanasos, Menelaos. **Prediction in ARMA models with GARCH in Mean Effects.** [Online]. Available: http://ideas.repec.org/p/yor/yorken/99-11.html. 2 March 2003.

Pindyck, Robert S. and Rubinfeld, Daniel L. **Econometric Models and Economic Forecasts,** 4th ed. New York: McGraw-Hill International, 1997.

Reuters. 2003. **Reuters Kobra™ version 3.5.1.** [Online]. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 14 March 2003.

Shumway , Robert H. and Stoffer, David S. **Time Series Analysis and Its Applications.** New York: Springer, 2000.

.....

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Chiang Mai University