

## เอกสารอ้างอิง

กรมการค้าภายใน. สำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า. 2551. **ดัชนีราคาขายวัสดุก่อสร้าง.**

แหล่งที่มา: <http://www.price.moc.go.th/content1.aspx?cid=5> (10 กุมภาพันธ์ 2549)

ขวัญชนก ธรรมวิวัฒน์. 2543. **ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์กับเครื่องชี้ทาง**

**เศรษฐกิจมหภาค.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ชิดชนก วงเครือ. 2547. **การพยากรณ์ดัชนีราคาวัสดุก่อสร้างโดยวิธีอาร์มี.** การค้นคว้าแบบอิสระ

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ณวรา สกุล ณ มรรคา. 2540. **ความสามารถในการพยากรณ์ของแบบจำลองการประเมินค่าออร์**

**เรนท.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ณัฐธิดา ชลนาคเกษม. 2547. **ความสามารถในการพยากรณ์ของเทคนิคบางเทคนิคของราคาหุ้น**

**กลุ่มวัสดุก่อสร้างและตกแต่ง.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2550. **รู้จักกับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** กรุงเทพฯ:

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐมิติ ทฤษฎีและการประยุกต์.** เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และ อารี วิบูลพงษ์. 2542. “พฤติกรรมการณ์ส่งผ่านกึ่งกลางระหว่างตลาดค้า

ส่ง โต้เกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ (กันยายน – ธันวาคม): 16-51.

ปฤถ ป่านทอง. 2548. **การประมาณค่าความผันผวนของราคาหุ้นด้วยวิธีการ์ช สำหรับการ**

**ประเมินค่าราคาใบสำคัญแสดงสิทธิ โดยแบบจำลองแบบลึคและโซลส์.** การค้นคว้าแบบ

อิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ปิยนุช เรืองขจร. 2550. **การประมาณค่าความผันผวนของผลตอบแทนของราคาน้ำมันดิบ ถ่านหิน**

**และก๊าซธรรมชาติ โดยวิธี อาร์มีอาร์ช อาร์มีอาร์ชเอ็ม และ อาร์มีอาร์ช.** การค้นคว้า

แบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- พัชรา ตันนวิจิตร. 2548. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณหลักทรัพย์ในกลุ่ม  
 วัสดุก่อสร้างและตกแต่งของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชัน.  
 การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ภัทร์ ตั้งตระกูล. 2546. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม: กรณีศึกษา  
 หลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุก่อสร้างและตกแต่ง. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร  
 มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วชิรภูมิ เบญจวัฒน์วงศ์. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ โดย  
 วิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต  
 มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. 2531. การวิเคราะห์หอนุกรมเวลา : ตำราประกอบการเรียนวิชาอนุกรมเวลา  
 และเลขดัชนี. มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒมหาสาร  
 คาม.
- ศูนย์วิจัยกสิกรไทย. ทางรอดก่อสร้างปี 51. แหล่งที่มา: [http://www.business.thai.co.th/content.php?data=412627\\_Power%20Thinking](http://www.business.thai.co.th/content.php?data=412627_Power%20Thinking) (10 พฤศจิกายน 2550)
- Black, F. 1976. "Studies of stock price volatility changes, Proceedings of the American  
 statistical association." **Business and Economic Statistics Section** p. 177-181.
- Booerslev. 1986. "Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity" **Journal of  
 Econometric** 31: 307-327.
- Datastream. 2008. **Datastream Version TDS 0x73090003**. Available: Finance and Investment  
 Center, Chiang Mai University. (February 13, 2008)
- Enders, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series**. New York: John Wiley.
- Fischer, Donald E. and Jordan, Ronald J. 1995. **Security Analysis and Portfolio  
 Managemant**. 6<sup>th</sup> ed. Englewood Cliffs: Prentice-Hall.
- Jaganathan and Runkle. 1993. "The Use of ARCH/GARCH Models in Applied Econometrics."  
**Journal of Economic Perspectives** 15: 157-168.
- Linter, J. 1965. "The Valuation of Risk Asset and the Selection of Risky Investments in Stock  
 Portfolios and Capital Budget." **Review of Economics and Statistics** 47, 1(February)  
 : 13-37.
- Markowitz, Harry. 1952. "Portfolio Selection." **Journal of Finance** 7(March): 77-91.

- Mossin, Jan. 1966. "Equilibrium in a Capital Asset Market." **Econometrica** 34, 4(October): 768-784.
- Nelson, Daniel B. 1991. "Conditional Heteroscedasticity in Asset Returns: a New Approach" **Econometrica** 59, 2: 347-370.
- Pindyck, R and Rubinfeld, D. 1998. **Econometric Models and Economic Forecasts**. 4<sup>th</sup> ed. New-York: McGraw-Hill.
- Poon, Jessie P. 1995. "Export Expansion, Economic Growth and Economics Development Revisited." **Journal of Economic Development** 20: 75-90.
- Sharma, Namit. 1998. **Forecasting Oil Price Volatility**. Available: <http://scholar.lib.vt.edu/theses/available/etd-5398-184344/unrestricted/etd.pdf> (December 15, 2006)
- Sharpe, William f. 1964. "Capital Asset Prices: A Theory of Market Equilibrium Under Condition of Risk." **Journal of Finance** 19, 3(September): 425-442.
- Zakoian and Glosten. 1994. "Threshold heteroskedastic Models." **Journal of Economic Dynamics and Control** 18: 931-944.