

เอกสารอ้างอิง

- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์**. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และ อารี วิบูลพงษ์. 2542. “พฤติกรรมการณ์การส่งผ่านกึ่งกลางระหว่างตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” **วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่** (กันยายน – ธันวาคม): 16-51.
- ปิยบุษ เรืองขจร. 2550. การประมาณค่าความผันผวนของผลตอบแทนของราคาน้ำมันดิบ ถ่านหิน และก๊าซธรรมชาติ โดยวิธี อาร์เอ็มเออาร์ เอ็ม และ อาร์เอ็มเออาร์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ภัทร์ ตั้งตระกูล. 2546. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองอาร์เอ็มเอ: กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุก่อสร้างและตกแต่ง. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. 2531. การวิเคราะห์อนุกรมเวลา: ตำราประกอบการเรียนวิชาอนุกรมเวลาและเลขดัชนี. มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒมหาสารคาม.
- Black, F. 1976. “Studies of Stock Price Volatility Changes, Proceedings of the American Statistical Association.” **Business and Economic Statistics Section** p. 177-181.
- Boerslev, Tim. 1986. “Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity.” **Journal of Econometric** 31: 307-327.
- Box, G.E.P. and Jenkins, G.M. 1976. **Time Series Analysis Forecasting and Control**. San Francisco, CA: Holden-Day Inc.
- Datastream. 2008. **Datastream Version TDS 0x73090003(online)**. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. (13 February 2008.)

- Enders, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series**. New York: John Wiley&Sons.
- Goyal, Amit. 2000. **Predictability of Stock Return Volatility from GARCH Model**.
 Availble: <http://bus.emory.edu/Agoya/docs/Garch.pdf> (15 January 2007)
- Gujarati, Damodar N. 1995. **Basic Econometrics**. 3rd ed. New York: McGraw Hill.
- Jaganathan and Runkle. 1993. "The Use of ARCH/GARCH Models in Applied Econometrics."
Journal of Economic Perspectives 15: 157-168.
- Najand, Mohammad. 2002. "Forecasting Stock Index Future Price volatility: Linear vs.
 Nonlinear Models." **Financial Review** 37: 93-104
- 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**. 4th ed.
 New-York: McGraw-Hill.
- Sharpe, William F. 1964. "Capital Asset Prices: A Theory of Market Equilibrium Under
 Conditions of Risk." **Journal of Finance** 19, 3 (September): 425-442
- Wold, H. 1954. **A Study in the Analysis of Stationary Time Series**. Stockholm: Almqvist &
 Wiksell .
- Zakoian and Glosten. 1994. "Threshold heteroskedastic Models." **Journal of Economic
 Dynamics and Control** 18: 931-944.