

เอกสารอ้างอิง

- ณรงค์ศักดิ์ วงศ์สิทธิกร. การวิเคราะห์ทางเศรษฐศาสตร์ที่เกี่ยวข้องกับการออก หุ้นสามัญ
หุ้นกู้ หุ้นกู้ควอเตอร์แรนท์ และหุ้นกู้แปลงสภาพ. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์
มหาบัณฑิตมหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- ฉวรา สกุด ณ มรรคา. ความสามารถในการพยากรณ์ของแบบจำลองการประเมินราคาควอเตอร์แรนท์.
วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และ อารี วิบูลพงษ์ “พฤติกรรมราคาส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดค้าส่ง
โตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย” วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
(กันยายน-ธันวาคม 2542): 16-51.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. การสำรวจพฤติกรรมออมของครัวเรือนในประเทศไทย. กรุงเทพฯ :
ธปท., 2538.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. [พฤติกรรมออมของครัวเรือนใน 2 ทศวรรษที่ผ่านมา](http://www.bot.or.th/BOTHomepage/search_th2.asp), [ทางเลือก
สำหรับผู้ลงทุน](http://www.bot.or.th/BOTHomepage/search_th2.asp) . http://www.bot.or.th/BOTHomepage/search_th2.asp 15 ธันวาคม 2547
- ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. การวิเคราะห์อนุกรมเวลา : ตำราประกอบการเรียนวิชาอนุกรมเวลาและ
เลขดัชนี. มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ มหาสารคาม,
2531.
- สวันญา เสนารัตน์. การพยากรณ์ราคาหุ้นโดยวิธีอาร์มา. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547.
- Baillie, R.T. and Bollerslev. T. “ Prediction in Dynamic Models with Time-Dependent
Conditional Variance.” **Journal of Economics** 52(1992): 91-113.
- Bollerslev, Tim. “Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity.” **Journal of
Economics** 31(1986): 307-327.
- Engle, R.F.; Lilien, D and Robins, R.P. “ Estimating Time Varing 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.**
Available: <http://bus.emory.edu/Agoya/docs/Garch.pdf> 15 December 2004
- 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.

Lawrence, J. Gitman and Joehnk Micheal D. **Fundamentals of Investment** 1981. New york
:Harper & Row

Leonard, David C. and Solt, Michael E. “On Using the Black-Scholes Model to Value Warrant.”
Journal of Financial Research 13, 2(Summer 1990) : 81-92.

“Statistical Hightlight of The Stock Exchange of Thailand & The Market for Alternative
Investment” ข้อมูลสถิติประจำเดือนของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย 30,5 (กันยายน
2004): 83-84.

Reuters. 2004. **Reuters Kobra™ Version 3.5.1**. Available: Finance and Investment Center,
Chiang Mai University. 9 December 2004.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved