

เอกสารอ้างอิง

- ขวัญหล้า จันทะพันธ์. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสาร
ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2551. **ดัชนีหลักทรัพย์**. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th>.
(15 กุมภาพันธ์ 2551)
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐมิติ ทฤษฎีและการประยุกต์**. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. “พฤติกรรม การส่งผ่านราคา กุ้งกุลาดำ ระหว่างตลาด
ค้าส่งโตเกียวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย” วารสารเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ (กันยายน-ธันวาคม): 16-51
- ธวัชชัย ช่างสม. 2548. การประเมินประสิทธิภาพของเครื่องมือทางเทคนิคสำหรับการวิเคราะห์ราคา
หุ้นกลุ่มพลังงานของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปาริฉัตร รัตนพั้วพันธ์. 2547. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชั่งเอ็ม กรณีศึกษา
หลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงาน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปิยนุช เรืองขจร. 2550. การประมาณค่าความผันผวนของผลตอบแทนของราคาน้ำมันดิบ ถ่านหิน
และก๊าซธรรมชาติ โดยวิธี อาร์มีอาร์ช อาร์มีอาร์ชเอ็มและอาร์มีอาร์ช. การค้นคว้าแบบ
อิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ภัทร์ ตั้งตระกูล. 2546. วิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชั่งเอ็มในหลักทรัพย์กลุ่มวัสดุ
ก่อสร้างและตกแต่ง. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. 2531. การวิเคราะห์หอนุกรมเวลา: ตำราประกอบการเรียนวิชาอนุกรมเวลา
และเลขดัชนี. มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ มหาสารคาม.
- ศุภชัย ศรีสุชาติ. 2547. **ตลาดหุ้นในประเทศไทย**. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

อำนาจ ลีชาติพิชญกุล. 2521. **การวิเคราะห์หลักทรัพย์**. กรุงเทพฯ: อมรินทร์.

Black, F. 1976. "Studies of Stock Price Volatility Changes, Proceedings of the American Statistical Association." **Business and Economic Statistics Section** p. 177-181

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

Box, G. and Jenkins, G. 1976. **Time series analysis; Forecasting and Control**. San Francisco: Holden Day.

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

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

Glosten; Jaganathan and Runkle. 1993. **Extensions and Modifications of GARCH**. Available: <http://pages.stern.nyu.edu/~rengle/Garch101.doc> (February 17, 2008)

Nelson, Daniel B., 1991. "Conditional Heteroskedasticity 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.

Reuters. **Reuters Kobra TM Version 3.5.1**. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. (February 13, 2008)

Sharpe. 1960. "Regulation, the Capital Asset Pricing Model, And the Arbitrage Pricing Theory." **Public Utilities Fortnightly** (May): 1073-1103

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

Zakoian. 1994. **Threshold ARCH models and asymmetries in volatility**. Available: <http://citeseer.ist.psu.edu/103850.html> (February 17, 2008)