

## เอกสารอ้างอิง

- กฤตวิทย์ อัจฉริยะพานิชกุล. 2550. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีหลักทรัพย์ล่วงหน้าของตลาด  
อนุพันธ์แห่งประเทศไทยกับตลาดอนุพันธ์ต่างประเทศ. การค้นคว้าแบบอิสระ  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ชบาฉาย สว่างแสง. 2551. แบบจำลองความผันผวนของผลตอบแทนในหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์  
ของกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีอาร์มาการซ์ อีการซ์ และที  
การซ์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. สถาบันพัฒนาความรู้ตลาดทุน. 2551. รู้จัก Index Options  
สำหรับเจ้าหน้าที่การตลาดอนุพันธ์. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- ณพล หงสกุลวสุ. 2550. ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนและการ  
เคลื่อนย้ายทุนของประเทศในเอเชีย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิติ ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลพงศ์. 2542. “พฤติกรรมการณ์ส่งผ่านราคาหุ้นอุตสาหกรรม  
ตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย. ” วารสารเศรษฐศาสตร์  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่(กันยายน-ธันวาคม): 16-51.
- น้ำริน ผลไสว. 2550. การวิเคราะห์ความผันผวนของอัตราผลตอบแทนของดัชนีราคาหลักทรัพย์  
ในตลาดหลักทรัพย์ไทย สิงคโปร์ มาเลเซีย อินโดนีเซีย และฟิลิปปินส์. วิทยานิพนธ์  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปฤถ ปานทอง. 2548. การประเมินค่าความผันผวนของราคาหุ้นด้วยวิธีการสำหรับการประเมิน  
ค่าราคาใบสำคัญแสดงสิทธิ โดยแบบจำลองแบล็คและซอลส์. การค้นคว้าแบบอิสระ  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปิยนุช เรืองขจร. 2550. การประมาณค่าความผันผวนของผลตอบแทนของราคาน้ำมันดิบ ถ่านหิน  
และก๊าซธรรมชาติ โดยวิธี อาร์มีอีการซ์ อาร์มาการซ์เอ็มและอาร์มาการซ์. การค้นคว้าแบบ  
อิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- พยชน์ หาญผดุงกิจ. 2532. อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ภัทร์ ตั้งตระกูล. 2545. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม : กรณีศึกษา หลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุก่อสร้างและตกแต่ง. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. 2531. การวิเคราะห์อนุกรมเวลา : ตำราประกอบการเรียนวิชาอนุกรมเวลา และเลขดัชนี. มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ มหาสารคาม.
- Black, F. 1976. "Studies of stock price volatility changes, Proceedings of the American Statistical Association." **Business and Economic Statistics**. p. 177-181.
- Bollerslev, Tim. 1986. "Generalized autoregressive conditional heteroskedasticity." **Journal of Econometrics** 31: 307-327.
- Box, G.E.P. and Jenkins, G.M. 1976. **Time series analysis forecasting and control**. San Francisco, CA: Holden-Day.
- Enders, Walter. 1995. **Applied econometric time series**. New York: John Wiley & Sons
- Engle and Bollerslev. 1986. "Modelling the persistence of conditional variances." **Econometric Reviews** 5(1): 1-50.
- Engle, R.F., Lilien, D.M. and Robins, R.P. 1987. "Estimating time-varying risk premia in the term structure: The ARCH-M Model." **Econometrica** 55: 391-408.
- Gujarati, Damodar N. 1995. **Basic econometrics**. 3<sup>rd</sup> ed. New York: Mc-Graw Hill.
- Jorion, P., Value at risk : The Benchmark for Managing Financial Risk, Second Edition, The McGraw-Hill Companies, Inc., 2000 , P.13-14.
- Nelson, Daniel B.. 1991. "Conditional heteroskedasticity in asset return: 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.
- Reuters. 2008. **Basic technical analysis**. N.P. : Reuters.
- Wold, H. 1954. **A study in the analysis of stationary time series**. Stockholm: Almqvist & Wiksell (1<sup>st</sup> ed., 1938).