

## เอกสารอ้างอิง

- จิตติมา ศรีจันทร์พานธุ์. 2538. ผลกระทบการปรับอัตราดอกเบี้ยธนาคารกลางสหรัฐอเมริกาต่อดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. ภาคนิพนธ์พัฒนบริหารศาสตรมหาบัณฑิต สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์
- ถนอมศรี ฟองงุ่นรุ่ง. 2537. การทดสอบระดับความผันผวนของหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิติ ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่ คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- ธัญย์ วงศ์กิริตวานิชย์. 2552. ดัชนีตราสาร. สถาบันพัฒนาความรู้ตลาดทุน. ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- นบพงศ์ เอี่ยมไพบุรุษพันธ์. 2547. การส่งผ่านของความผันผวนของอัตราดอกเบี้ยจากประเทศไทยไปประเทศในภูมิภาคเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ในช่วงวิกฤตเศรษฐกิจเอเชีย. วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
- น้ำริน ผลไสว. 2550. การวิเคราะห์ความผันผวนของอัตราผลตอบแทนของดัชนีราคาหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ไทย สิงคโปร์ มาเลเซีย อินโดนีเซีย และฟิลิปปินส์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- ปฎุฒ ป่านทอง. 2548. การประเมินค่าความผันผวนของราคาหุ้นด้วยวิธีการสำหรับการประเมินค่าราคาใบสำคัญแสดงสิทธิ โดยใช้แบบจำลองแบล็คและซอลล์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- ปิยนุช เรืองขจร. 2550. การประมาณค่าความผันผวนของผลตอบแทนของราคาน้ำมันดิบ ถ่านหิน และก๊าซธรรมชาติโดยวิธีอาร์มีอาร์ช อาร์มีอาร์ชเอ็มและอาร์มีอาร์ช. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- รัตนา สายคณิต. 2544. มหเศรษฐศาสตร์วิเคราะห์: จากทฤษฎีสู่นโยบาย. ตำราลำดับ 18 พิมพ์ครั้งที่ 4. ของโครงการพัฒนาตำรา ศูนย์บริการเอกสารวิชาการ คณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

- สธนพล วิเชียรรัตน์พันธ์. 2547. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม:  
กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์  
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- ห้องสมุดไทยพาณิชย์ออนไลน์ “จับตาสังคโปร์”. 2550. [ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา:  
[http://www.scb.or.th/bothomepage/libraryonline/About\\_Invesment/  
Asin/Singapor\\_watch.html](http://www.scb.or.th/bothomepage/libraryonline/About_Invesment/Asin/Singapor_watch.html).
- อภิสิทธิ์ สรรพคติก. 2547. การส่งผ่านความไม่แน่นอนของปัจจัยที่มีผลในตลาดซื้อขายไฟฟ้าจาก  
ประสบการณ์ของต่างประเทศโดยใช้วิธีแบบจำลอง **MULTIVARIATE GARCH**.  
วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
- Bollerslev, Engle and Wooldridge. 1988. “Generalized autoregressive conditional  
heteroskedasticity” **Journal of Econometrics** 31: 307-327.
- Dickey, D. A. , and W. A, Fuller. 1981. “Likelihood ratio statistic for autoregressive time series  
with a unit root” **Econometrica** 49. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐมิติ:  
ทฤษฎีและการประยุกต์**. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Enders, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series**. New York: John Willey and Sons.
- Fang, V., Y. C. Lim, and C. T. Lin. 2007. **Volatility Transmissions Between Stock And Bond  
Markets: Evidence From Japan And The U.S.**. School of Business and School of  
Commerce, University of Adelaide, Adelaide SA 5000 Australia
- Goyal, Amit. 2000. **Predictability of Stock Return Volatility from GARCH Model**  
Available:<http://bus.emory.edu/Agoya/docs/garch.pdf> (15 Dem 2006)
- Gujarati, Damodar N. 2003. **Basic Econometrics**. 4<sup>th</sup> ed. New York: McGraw-Hill Internation
- Philip J. Young and Robert R. Johnson. 2004. **Bond Market Volatility VS. Stock Market  
Volatility: The Swiss Experience**. Swiss Society for Financial Market Research (pp.  
8-23)
- Reuter. 2007. **Reuters Kobra** TM Vresion 3.5.1. Available: Finance And Investment Center,  
Chiang Mai University (26 March 2007)
- Ronald, David and Pual. 2004. **The Impact of Stock market volatility on corporate bond  
credit spreads**. *Mathematics and Computers in Simulation* 64 (2004) 363-372
- Wikimedia Foundation. 2009. **Autoregressive conditional heteroskedasticity**. [Online]  
Available: <http://en.wikipedia.org/wiki/GARCH>.