

เอกสารอ้างอิง

- กรกนก วิภูสุ. (2548). การวิเคราะห์อัตราผลตอบแทน ความเสี่ยง และปัจจัยที่มีผลกระทบต่อราคาหลักทรัพย์หมวดธุรกิจโรงแรมและบริการ ท่องเที่ยว ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์.
- กรมเจรจาการค้าระหว่างประเทศ. (2555). ประวัติความเป็นมา AEC. สืบค้นเมื่อ 14 ตุลาคม 2555, จาก <http://www.dtn.go.th>
- กฤตวร ตั้งประเสริฐผล. (2553). การวิเคราะห์อัตราผลตอบแทน ความเสี่ยง และการตัดสินใจลงทุนในหลักทรัพย์กลุ่มธุรกิจเกษตรและอุตสาหกรรมอาหาร. มหาวิทยาลัยเทคโนโลยีพระจอมเกล้าธนบุรี.
- เกรียงศักดิ์ พรพนาวรรณ. (2550). บทบาทตลาดหลักทรัพย์ต่อประสิทธิภาพการดำเนินงานของธุรกิจประกันภัย. มหาวิทยาลัยรามคำแหง.
- คธาฤทธิ สีทธิกุล. (1998). การศึกษาพฤติกรรมราคาและการพยากรณ์ราคาสินค้ามันสำปะหลัง. Kasetsart Bangkok (Thailand).
- จุฬามาศ สุพรจักร. (2552). การวิเคราะห์ความผันผวนของอัตราผลตอบแทนของดัชนีราคาหลักทรัพย์ล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ไทย สหรัฐอเมริกา ญี่ปุ่น และฮ่องกง. มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, เชียงใหม่.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. (2545). การลงทุน. กรุงเทพมหานคร: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ชิดชนก มหาพิรบุตร. (2553). การศึกษาระดับความสำคัญในมิติด้านต่าง ๆ ต่อการลงทุนของกองทุนรวมที่มีผลต่อพฤติกรรมการลงทุนของนักลงทุนรายย่อยที่ลงทุนผ่านกองทุนรวมในเขตกรุงเทพมหานคร. มหาวิทยาลัยบูรพา.
- ชูศักดิ์ เอื้อธรรมมิตร. (2551). การใช้เทคนิค Value at Risk (VaR) ในการจัดการความเสี่ยงการลงทุนหลักทรัพย์ภายในตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ. สถาบันเทคโนโลยีพระจอมเกล้าเจ้าคุณทหารลาดกระบัง.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. (2545a). การวิเคราะห์หลักทรัพย์โดยใช้ปัจจัยพื้นฐาน. สืบค้นเมื่อ 16 มีนาคม 2545, จาก <http://www.bualuang.co.th/le/help/kw/ebook003.pdf>
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. (2545b). ก้าวแรกสู่การลงทุนในตลาดหลักทรัพย์. สืบค้นเมื่อ 16 มีนาคม 2545, จาก www.bualuang.co.th/le/help/kw/ebook001.pdf

- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. (2546). *หลักสูตรความรู้พื้นฐานเกี่ยวกับตลาดเงินและตลาดทุน*.
จาก www.mfcfund.com/php/th/talent.../FK_4.pdf
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. (2555). *การลงทุน*. สืบค้นเมื่อ 10 ตุลาคม 2555, จาก
http://www.set.or.th/th/faqs/investment_p1.html
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. (2547). *เศรษฐมิติ: ทฤษฎีประยุกต์*. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- นัยเนตร เกตุสุวรรณ. (2549). *ความมีประสิทธิภาพของการวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานต่อผลตอบแทนของ
หุ้นในอนาคต*. จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- นิคม ไวยรัชพานิช. (2555). *เรื่องดี ๆ มีมาแล้ว ตอนเปิดประตูสู่ประชาคมเศรษฐกิจอาเซียน (AEC)*.
ค้นเมื่อ 14 ตุลาคม 2555, จาก [http://www.thai-senate.com/senate_inter/upload-
download/article/show_file.php?id=25](http://www.thai-senate.com/senate_inter/upload-download/article/show_file.php?id=25)
- บริษัทหลักทรัพย์ เคทีบี (ประเทศไทย) จำกัด. (2555). *ปัจจัยที่เกี่ยวข้องกับการลงทุน*. สืบค้นเมื่อ 10
ตุลาคม 2555, จาก <http://www.ktbt.co.th/thd/thai/investmanual/investmanual>
- ปฎุต ปานทอง. (2548). *การประมาณค่าความผันผวนของราคาหุ้น ด้วยวิธีการสำหรับการประเมินค่า
ราคาใบสำคัญแสดงสิทธิ โดยแบบจำลอง แบบลึกลับและโซลส์*. มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปณิฏฐา ชีสังวรณ. (2550). *การวิเคราะห์อัตราผลตอบแทนความเสี่ยงและปัจจัยที่มีผลกระทบต่อราคา
หลักทรัพย์หมวดธุรกิจพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย*.
มหาวิทยาลัยสุโขทัยธรรมมาธิราช
- ประยูร ดำรงจิตานนท์. (2555). *ทิศทางธุรกิจอสังหาริมทรัพย์ไทยในการเข้าสู่ประชาคมเศรษฐกิจ
อาเซียน ปี 2015*. ธนาคารอาคารสงเคราะห์ วารสารรายไตรมาส, 70.
- ประสาร ไตรรัตน์วรกุล. (2555). *GDP ปัจจุบันสะท้อนให้เห็นถึงความแข็งแกร่งของเศรษฐกิจไทยแค่ไหน*.
ธนาคารอาคารสงเคราะห์ วารสารรายไตรมาส, 70.
- พิจิตต์ อินตา. (2551). *การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราเงินเฟ้อกับอัตราดอกเบี้ยโตทาง
เศรษฐกิจของประเทศไทยด้วยแบบจำลองไบบารจการ์ช*. มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เพชร ชุมทรัพย์. (2544). *หลักการลงทุน*. กรุงเทพมหานคร: มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- เพชรลักษณ์ บุญญาคุณากร. (2552). *การวิเคราะห์ความผันผวนราคาทองคำแท่งในรูปของค่าเงินบาท*.
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ภาวิกร ชพิมสาร. (2547). *การประเมินประสิทธิภาพการวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์กลุ่ม
ธุรกิจธนาคารและหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย*. มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วินัส ฤกษ์ชัย. (2551). *เศรษฐศาสตร์สถิติ*. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- จิรัตน์ สังข์แก้ว. (2545). *การลงทุน*. กรุงเทพฯ ฯ: มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- จิตชนก มหาพิรบุตร. (2553). *การศึกษาระดับความสำคัญในมิติด้านต่าง ๆ ต่อการลงทุนของกองทุนรวมที่มีผลต่อพฤติกรรมการลงทุนของนักลงทุนรายย่อยที่ลงทุนผ่านกองทุนรวมในเขตกรุงเทพมหานคร*. มหาวิทยาลัยบูรพา.
- ชูศักดิ์ เอื้อธรรมมิตร. (2551). *การใช้เทคนิค Value at Risk (VaR) ในการจัดการความเสี่ยงการลงทุนหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ*. สถาบันเทคโนโลยีพระจอมเกล้าเจ้าคุณทหารลาดกระบัง.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. (2547). *เศรษฐมิติ:ทฤษฎีประยุกต์*. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- นนทพร จำปาวาน. (2550). *การประมาณค่าความผันผวนสำหรับอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศไทย โดยแบบจำลองอาร์มีการ์ชและแบบจำลองอาร์มีการ์ช*. มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- บริษัท เว็ลธ์ แมเนจเม้นท์ ซิสเต็ม จำกัด. (2551) *ค้นหากองทุน*. สืบค้นเมื่อ 25 เมษายน 2551, จาก <http://www.wealthmagik.com/Screener/BasicScreener.aspx>
- บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ฟินันซ่า จำกัด. (2552) *โกอินเตอร์กับ FIF*. สืบค้นเมื่อ 17 มกราคม 2552, จาก http://www.finansa-asset.com/recently/articles/th_one_article2.html
- บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม วรณ จำกัด. (2547) *กองทุนรวมที่ลงทุนในต่างประเทศ*. สืบค้นเมื่อ 6 กันยายน 2547, จาก <https://www.one-asset.com/?p=2754>
- ปฎุฒ ป่านทอง. (2548). *การประมาณค่าความผันผวนของราคาหุ้น ด้วยวิธีการสำหรับการประเมินค่าราคาใบสำคัญแสดงสิทธิ โดยแบบจำลองแบล็คและโชลส์*. มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปณิฏฐา ชีสังวรรณ. (2550). *การวิเคราะห์อัตราผลตอบแทนความเสี่ยงและปัจจัยที่มีผลกระทบต่อราคาหลักทรัพย์หมวดธุรกิจพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย*. มหาวิทยาลัยสุโขทัยธรรมมาธิราช.
- พิจิตต์ อินตา. (2551). *การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราเงินเฟ้อกับอัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของประเทศไทยด้วยแบบจำลองไบวาเรจการ์ช*. มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เพชร ชุมทรัพย์. (2544). *หลักการลงทุน*. กรุงเทพมหานคร: มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ภาวิกร ชศพิมสาร. (2547). *การประเมินประสิทธิภาพการวิเคราะห์ทางเทคนิคของหลักทรัพย์กลุ่มธุรกิจธนาคารและหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย*. มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- รสสุคนธ์ เรื่องพิพัฒน์พันธุ์. (2551). *แบบจำลองความผันผวนของผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีอาร์มีการ์ช อี การ์ช และทีการ์ช*. มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- วินัส ฤกษ์ชัย. (2551). *เศรษฐศาสตร์สถิติ*. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ศูนย์วิจัยกสิกรไทย. (2550) กองทุน FIF ปี 51 เติบโตจากกองทุนตราสารหนี้ต่างประเทศ. สืบค้นเมื่อ 14 มิถุนายน 2550, จาก <https://www.kasikornresearch.com/TH/KEconAnalysis/Pages/ViewSummary.aspx?docid=14765>
- ศราววุฒิปัทธน์. (2553) FIF ทางเลือกในการลงทุน ยามเงินบาทแข็งค่า. สืบค้นเมื่อ 12 มีนาคม 2553, จาก <http://sarawutpata.blogspot.com/2010/09/fif.html>
- สมาคมบริษัทจัดการลงทุน. (2551). *ประเภทของกองทุนรวม*. สืบค้นเมื่อ 8 พฤศจิกายน 2551, จาก http://www.tsi-thailand.org/index.php?option=com_content&task=view&id=1834
- สิริชัย พึ่งวัฒนาพงศ์. (2553). ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของการลงทุนในกองทุนรวม อสังหาริมทรัพย์ (กอง 1). มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ.
- Bauwens, L., Laurent, S., & Rombouts, J. V. K. (2006). Multivariate GARCH models: A survey. *Journal of Applied Econometrics*, 21, 79-109.
- Bodie, Z., Kane, A., & Marcus, A. J. (2008). *Empirical evidence on security returns* (7th ed.): McGraw-Hill.
- Bollerslev, T. (1986). Generalized autoregressive conditional heteroskedasticity. *Journal of Econometrics*, 31(3), 307-327.
- Bollerslev, T. (1990). Modeling the coherence in short-run nominal exchange rates: A multivariate generalized ARCH model. *Review of Economics and Statistics*, 72, 498-505.
- Bollerslev, T. (2007). Glossary to ARCH (GARCH). *CREATES Research Paper 49*.
- Bollerslev, T., Engle, R. F., & Wooldridge, J. M. (1988). A capital asset pricing model with time-varying covariances. *Journal of Political Economy*, 96(1), 116-131.
- Brillinger, D. R. (2001). *Time Series Data Analysis and Theory*. San Francisco: Holden Day.
- Dickey, D. A., & Fuller, W. A. (1981). Likelihood ratio statistics for autoregressive time series with unit root. *Econometrica* 49(4)(July), 1057-1071.
- Elliott, G., Rothenberg, T. J., & Stock, J. H. (1996). Efficient tests for an autoregressive unit root. *Econometrica*, 64(4)(July), 813-836.
- Engle, R. F. (1982). Autoregressive conditional heteroscedasticity with estimates of the variance of United Kingdom inflation. *Econometrica*, 50(4)(July).
- Engle, R. F., & Kroner, K. F. (1995). Multivariate simultaneous generalized Arch. *Econometric Theory*, 11, 122-150.

- Germany. Wolfgang Polasek, & Ren, L. (2001). *Volatility analysis during the Asia crisis: a multivariate GARCH-M model for stock returns in the U.S., Germany and Japan* University of Basel Holbeinstrasse, Basel, Switzerland.
- Hannan, E. J., & Quinn, B. G. (1979). The determination of the order of an autoregression. *Journal of the Royal Statistical Society*, 41(2), 190-195.
- Kirchgassner, G., & Wolters, J. (2007). Introduction to modern time series analysis. Berlin: Springer.
- Ling, S., & Li, W. K. (1997). Diagnostic checking of nonlinear multivariate time series with multivariate arch errors. *Journal of Time Series Analysis*, 18(5), 447-464.
- Ling, S., & McAleer, M. (2003). On adaptive estimation in nonstationary ARMA models with GARCH errors. *Annals of Statistics*, 31(2), 642-674.
- Manera M., McAleer M. and Grasso M. (2004), "Modelling dynamic conditional correlations in the volatility of spot and forward oil price returns", in C. Pahl, S. Schmidt and T. Jakeman (eds), iEMSs 2004 International Congress: "Complexity and Integrated Resources Management", International Environmental Modelling and Software Society, Osnabrueck, Germany.
- Minovic, J. (2008). Application and diagnostic checking of univariate and multivariate GARCH models in Serbian financial market. *Economic Analysis*, 40.
- Phillips, P. C. B., & Perron, P. (1988). Testing for a unit root in time series regression. *Biometrika*, 75, 335-346.
- Priyaa, D. S., Kavitha, B., Kumar, R. N., & Banuroopa, K. (2010). Improving BayesNet classifier using various feature reduction method for spam classification. *IJCST*, 1(2).
- Qiao, Z., Smyth, R., & Wong, W.-K. (2008). Volatility switching and regime interdependence between information technology stocks. *Global Finance Journal*, 19(2), 139-156.
- Recklies, D. (2001). Porters 5 forces. Retrieved October 12, 2012, from <http://www.themanager.org/models/p5f.htm>
- Said, S. E., & Dickey, D. A. (1984). Testing for unit roots in autoregressive moving average models of unknown order. *Biometrika*, 71, 599-607.
- Serletis, A., & Shahmoradi, A. (2006). Velocity and the variability of money growth : Evidence from a VARMA, GARCH-M model. *Macroeconomic Dynamics*, 10(5), 652-666.

The Stock Exchange of Thailand. (2012). SET index series. Retrieved September 20, 2012, from <http://www.set.or.th>

Tu, S., & Xu, L. (2012). A theoretical investigation of several model selection criteria for dimensionality reduction. *Pattern Recognition Letters*, 33, 1117-1126.

Turkheimer, F. E., Hinz, R., & Cunningham, V. J. (2003). On the undecidability among Kinetic models: from model selection to model averaging. *Journal of Cerebral Blood Flow & Metabolism*, 23, 490-498.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved