เอกสารอ้างอิง

จิตติ ตันเสนีย์. 2548. **การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์ราคาหลักทรัพย์ระหว่างแบบจำลองนิวรอลเน็ตเวอร์กับแบบจำลองอารีมาและอีการ์ชเอ็ม.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2542. **การลงทุน.** กรุงเทพ : มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์.** เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และ อารี วิบูลย์พงศ์. 2542. "พฤติกรรมการส่งผ่านราคากุ้งกุลาดำระหว่างตลาดค้าส่งโตเกียวกับตลาดคัดบรรจุในประเทศไทย." **วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่** 33: 16-51

นนทพร จำปาวัน 2550. **การประมาณค่าความผันผวนสำหรับอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศไทยโดยแบบจำลองอารีมาการ์ชและแบบจำลองอารีมาอีการ์ช**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ปิยนุช เรืองขจร. 2549. **การประมาณค่าความผันผวนของผลตอบแทนของราคาน้ำมันดิบ ถ่านหินและก๊าซธรรมชาติ โดยวิธี อารีมาอีการ์ช อารีมาการ์ชเอ็มและอารีมาการ์ช.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

พรกมล ปัญจะธง. 2548. **วิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการ์ชเอ็มของหุ้นกลุ่มขนส่ง**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

เยาวลักษณ์ จันทร์ดี. 2547. **วิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการ์ชเอ็ม:กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสาร.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. 2531. **การวิเคราะห์อนุกรมเวลา: ตำราประกอบการเรียนวิชาอนุกรมเวลาและเลขดัชนี.** มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

Datastream. 2008. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. (February 13, 2008.)

Bollerslev, Tim 1986. "Generalized autoregressive conditional heteroscedasticity." **Journal of Econometrics** 31: 307-327.

Engle, Robert F. 1982. "Autoregressive conditional heteroscedasticity with estimates of variance of United Kingdom inflation." **Econometrica** 50: 987-1008.

Fischer,D.E. and Jordan, R.J. 1995. **Security analysis and portafolio management**. New York: Prentice Hall

Magnus, Frimpong Joseph and Fosu, 2Oteng-Abayie Eric. **Modelling and Forecasting Volatility of Returns on the Ghana Stock Exchange Using Garch Models**. Available: http://www.scipub.org/fulltext/ajas/ajas3102042-2048.pdf

Nelson, D. B. 1991. "Conditional heteroskedasticity in asset returns: A new approach." **Econometrica** 59: 347-370.

Pindyck, R. and Rubinfeld, D. 1998. **Econometric models and economic forecasts**. 4th ed. New-York: McGraw-Hill.

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

Sharpe,W.F. 1964. "Capital Asset Prices: A Theory of Market Equilibrium Under Conditions of Risk." **Journal of Finance**. 19: 425-442. อ้างถึงใน จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2542. **การลงทุน.** กรุงเทพ : มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์

Wold, H. 1938. **A study in the analysis of stationary time series.** 1st ed. Stockholm: Almquist&Wiksell.

Zakoian, Jean-Michel 1994. "Threshold heteroskedastic models." **Journal of Economic Dynamics and Control** 18(5): 931-955.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved