

## เอกสารอ้างอิง

- กนกกาญจน์ ทวีอภิรดีเจริญ. ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อราคาหุ้นในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2541
- ชีวิน กันธอ้าย. การพยากรณ์ราคาอย่างพาราโดโดยวิธีอาร์มา. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2552. ข้อมูลย้อนหลัง: ราคาซื้อขายหลักทรัพย์  
แหล่งที่มา: [www.settrade.com/C04\\_02\\_stock\\_historical\\_p1.jsp?](http://www.settrade.com/C04_02_stock_historical_p1.jsp?)
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตติ: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงส์. “พฤติกรรมการณ์ส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดระหว่างตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดคัฒบรจในประเศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 33,3 (กันยายน-ธันวาคม 2542): 16-15
- ทรงศิริ เต้สมบัติ. เทคนิคการพยากรณ์เชิงปริมาณ. กรุงเทพฯ: ฟิสิกส์เซ็นเตอร์, 2539
- เบญจพร อู่สมบัติชัย. การพยากรณ์ราคาไปโดยวิธีอาร์มา. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547
- ปริญญา ปทุมแสงทอง. การพยากรณ์ราคาหลักทรัพย์กลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์บางหลักทรัพย์โดยวิธีอาร์มา. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547
- ปิยบุษ เรืองขจร. การประมาณค่าความผันผวนของผลตอบแทนของราคาน้ำมันดิบ ถ่านหิน และก๊าซธรรมชาติโดยวิธีอาร์มา อาร์มาการซ์เอ็มและอาร์มาการซ์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2550
- ภัทร์ ตั้งตระกูล. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการซ์เอ็ม: กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มก่อสร้างและตกแต่ง. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2550
- วชิรภูมิ เบญจวัฒนวงศ์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์โดยวิธีการลดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

- วิสุมิตรา วงศ์เลี้ยงถาวร.การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนา  
อสังหาริมทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้วิธีโคอินทิเกรชันและเอเรอร์คอร์  
เร็คชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- ศิริลักษณ์ เล็กสมบุญ. การวิเคราะห์อนุกรมเวลา: ตำราประกอบการเรียนอนุกรมเวลาและดัชนี.  
มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒมหาสารคาม, 2531
- ศรณพล วิเชียรรัตนพันธ์. 2547 การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการ์ชเอ็ม: กรณีศึกษา  
หลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547
- Celso Brunetti. 1999. **LONG MEMORY, THE .TAYLOR EFFECT. AND INTRADAY  
VOLATILITY IN COMMODITY FUTURES MARKETS.** [Online]. Available:  
<http://www.ssc.upenn.edu/~celsob/pap2.PDF>. (24 March 2010)
- Chukiat Chaiboonsri, et.al. 2010. **International Tourist arrivals in Thailand:  
Forecasting with ARFIMA-FIGARCH Approach.** [online] Available  
[http://www.scribd.com/doc/27858486/Tourism-Eco-No\\_Metrics-1-2010](http://www.scribd.com/doc/27858486/Tourism-Eco-No_Metrics-1-2010) (20 April 2010)
- Enders, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series.** New York: John Wiley & Sons.
- Emrah Ismail ;Çevik, Nesrin Özataç and Turhan Korkmaz. 2009. **Testing for Long Memory in  
ISE Using ARFIMA-FIGARCH Model and Structural Break Test.**[Online].  
Available: <http://www.eurojournals.com/finance.htm>. (24 March 2010)
- Karanasos, Menelaos. **Prediction in ARMA models with GARCH in Mean Effects.** [Online].  
Available: <http://ideas.repec.org/p/yor/yorken/99-11.html>. (24 March 2010)
- Nelson, Daniel B. 1991. **“Conditional Heteroskedasticity in Asset Returns: A New  
Approach”** *Econometrica* 59-2(Match):347-370
- Piotr Fiszeder. 2008. **.DYNAMIC ECONOMETRIC MODELS.** [Online]. Available:  
[http://www.dem.umk.pl/dem/archiwa/v8/14\\_Fiszeder.pdf](http://www.dem.umk.pl/dem/archiwa/v8/14_Fiszeder.pdf). (26 March 2010)