

เอกสารอ้างอิง

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2550. ภาพรวมตลาดทุนไทยเชิงเปรียบเทียบ. แหล่งที่มา:

http://www.set.or.th/setresearch/files/B_graph_comparative_0807.pdf

(22 กรกฎาคม 2550)

_____. 2550. ภาพตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศ. แหล่งที่มา:

http://www.sec.or.th/infocenter/report/Content_0000000173.jsp?categoryID=CAT00002

83 (22 กรกฎาคม 2550)

ฉนวนศรี ฟองงุ่นรุ่ง. 2537. การทดสอบระดับความผันผวนของหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

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

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลพงศ์. 2542. “พฤติกรรมราคาส่งผ่านราคาหุ้นในตลาด
ค้าส่งโตเกียวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย” วารสารเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ (กันยายน-ธันวาคม): 16-51.

ปฎุ ปานทอง. 2548. การประเมินค่าความผันผวนของราคาหุ้นด้วยวิธีการสำหรับการประเมิน
ค่าราคาใบสำคัญแสดงสิทธิ โดยแบบจำลองแบล็คและโชลส์. การค้นคว้าแบบอิสระ
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ปิยนุช เรืองขจร. 2550. การประมาณค่าความผันผวนของผลตอบแทนของราคาน้ำมัน ถ่านหิน
และก๊าซธรรมชาติ โดยวิธี อาร์มีเอการ์ช อาร์มาร์ชเอ็มและอาร์มาร์ช. การค้นคว้าแบบ
อิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

พิชานัน อรัณยธนาค. 2545. ความสัมพันธ์ระหว่างปัจจัยพื้นฐานทางเศรษฐกิจและความผันผวนของอัตราผลตอบแทนในตลาดหลักทรัพย์ในช่วงวิกฤตเศรษฐกิจของเอเชียตะวันออกโดยวิธีการ อะซิมเมตริกการช. วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

ภัทร์ ตั้งตระกูล. 2545. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม : กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุก่อสร้างและตกแต่ง. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. 2531. การวิเคราะห์อนุกรมเวลา: ตำราประกอบการเรียนวิชาอนุกรมเวลาและเลขดัชนี. มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒมหาสารคาม.

อัญญา ชันชวิทย์. 2547. การวิเคราะห์ความเสี่ยงจากการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

Black, F. 1976. "Studies of stock price volatility changes, Proceedings of the American Statistical Association." **Business and Economic Statistics Section** p. 177-181.

Bollerslev, Tim. 1986. "Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity." **Journal of Econometrics** 31: 307-327.

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. 1982. "Autoregressive conditional heteroskedasticity with estimates of the variance of U.K. inflation" **Econometrica** 45: 987-1007.

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.

Goyal, Amit. 2000. **Predictability of Stock Return Volatility from GARCH Model.**

Available: <http://bus.emory.edu/Agoya/docs/Garch.pdf> (15 December 2006).

Gujarati, Damodar N. 1995. **Basic Econometrics**. 3rd ed. New York: McGraw Hill.

Jones, Charles P. and Wilson, Jack W.. 1989. "Is stock price volatility Increasing?" **Financial Analysis Journal** (November-December) p. 20-26.

Merville, Larry J. and Pieptea, Dan R.. 1989. "Stock-Price Volatility, Mean-Reverting Diffusion, and Noise." **Journal of Financial Economics** p. 193-217.

Najand, Mohammad. 2002. "Forecasting Stock Index Future Price Volatility: Linear vs. Nonlinear Models." **The Financial Review** 37: 93-104.

Nelson, Daniel B.. 1991. "Conditional heteroskedasticity in asset returns: a new approach" **Econometrica** 59,2: 347-370.

Pindyck, R and Rubinfeld, D. 1998. **Econometric Models and Economic Forecasts**. 4th ed. New-York: McGraw-Hill.

Reuters. 2007. **Reuters Kobra™ Version 3.5.1**. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University (26 March 2007).

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved