

เอกสารอ้างอิง

- กนกกาญจน์ ทวีอภิรดีเจริญ. ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อราคาหุ้นหมวดอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2541.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2540.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. "พฤติกรรมการณ์การส่งผ่านราคาหุ้นอุตสาหกรรมค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย." วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 33,3(กันยายน-ธันวาคม 2542): 16-51.
- บริษัท หลักทรัพย์ไอบี จำกัด. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.ibtrade.com>. 15 พฤษภาคม 2547.
- ภัทร์ ตั้งตระกูล. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองอาร์ชเอ็ม: กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุก่อสร้างและตกแต่ง. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- ศิริลักษณ์ เล็กสมบุญ. การวิเคราะห์อนุกรมเวลา: ตำราประกอบการเรียนวิชาอนุกรมเวลาและเลขดัชนี. มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ มหาสารคาม, 2531.
- วชิรภูมิ เบญจวัฒน์วงศ์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- วิสุมิตรา วงศ์เลี้ยงดาว. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้วิธีโคอินทิเกรชันและเอเรอร์คอร์เรคชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- Baillie, R.T. and Bollerslev, T. "Prediction in Dynamic Medels with Time-Dependent Conditional Variances." *Journal of Econometrics* 52(1992): 91-113.
- Bollerslev, Tim. "Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity." *Journal of Econometrics* 31(1986): 307-327.

- Brailsford, Timothy. "Market Closures and Time-Varying Volatility in the Australian Equity Market." *Journal of Empirical Finance* 2(1995): 165-172.
- Choudhry, Taufiq. "Stock Market Volatility and the Crash of 1987: Evidence from Six Emerging Markets." *Journal of International Money and Finance* 15,6(1996): 969-981.
- Devaney, Michael. "Time Varying Risk Premia for Real Estate Investment Trusts: A GARCH-M Model." *The Quarterly Review of Economics and Finance* 41(2001): 335-346
- Enders, Walter. *Applied Econometric Time Series*. New York: John Wiley & Sons, 1995.
- Engle, R.F.; Lilien, D and Robins, R.P. "Estimating Time Varying Risk Premia in the Term Structure: The ARCH-M model." *Econometrica* 55(1987): 391-407.
- Goyal, Amit. 2000. *Predictability of Stock Return Volatility from GARCH Models*. [Online]. Available: <http://www.bus.emory.edu/Agoya/docs/Garch.pdf>, 2003.
- Ito, Akitoshi. "Profits on Technical Trading Rules and Time-Varying Expected Returns: Evidence from Pacific-Basin Equity Markets." *Pacific-Basin Finance Journal* 7(1999): 283-330.
- Karanasos, Menelaos. *Prediction in ARMA models with GARCH in Mean Effects*. [Online]. Available: <http://ideas.repec.org/p/yor/yorken/99-11.html>. 1 January 2004.
- Reuters. 2003. *Reuters Kobra™ version 3.5.1*. [Online]. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University, 9 November 2003.