

เอกสารอ้างอิง

- เขมรัฐ ชัยมงคล. (2553). การวิเคราะห์ความผันผวนของอัตราผลตอบแทนของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้แบบจำลองระบบความจำระยะยาว. เชียงใหม่: มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ชาตญาณ วิพัฒนานันทกุล. (2553). การจำลองและการพยากรณ์ความผันผวนและราคาของออปชันที่อ้างอิงกับดัชนี 50 ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. เชียงใหม่: มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. (2559). ดัชนีตลาดหลักทรัพย์. ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. เข้าถึงเมื่อ 9 มีนาคม 2559, จาก http://www.set.or.th/th/products/index/setindex_p3.html
- บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน). (2559). *TFEX : Thailand Futures Exchange*. สินค้าในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า. เข้าถึงเมื่อ 9 มีนาคม 2559, จาก <http://www.tfex.co.th/th/products/products.html>
- อนันตปริย์ ไซวรรณ. (2552). ความจำระยะยาวและการพยากรณ์ความผันผวนในผลตอบแทนของสินทรัพย์ทางการเงิน. เชียงใหม่: มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อนุสร ต่ายหัวแดง. (2551). การประมาณค่าความผันผวนสำหรับผลตอบแทนของดัชนีกลุ่ม 50 หลักทรัพย์ ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยใช้แบบจำลองอาร์มา-การ์ช. เชียงใหม่: มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Black, F. (1976). Studies of Stock Price Volatility Changes. *Proceedings of the 1976 Meetings of the American Statistical Association, Business & Economic Statistic Section*, (pp.177-181).
- Black, F., & Scholes, M. (1973). The Pricing of Options and Corporate Liabilities. *The Journal of Political Economy*, 81(3), 637-654.
- Bollerslev, T. (1986). Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity. *Journal of Econometrics*, 31, 307-327.
- Brockwell, P. J., & Davis, R. A. (1991). *Time Series: Theory and Methods* (2 ed.). New York: Springer.
- Dickey, D. A., & Fuller, W. A. (1979). Distribution of the Estimators for Autoregressive Time Series With a Unit Root. *Journal of the American Statistical Association*, 74(366), 427-431.

- Dumas, B., Fleming, J., & Whaley, R. E. (1998). Implied Volatility Functions: Empirical Tests. *The Journal of Finance*, 53(6), 2059-2106.
- Gujarati, D. N. (2004). *Basic Econometrics* (4 ed.). New York: McGraw-Hill.
- Harvey, C. R., & Whaley, R. E. (1992). Dividends and S&P 100 Index Option Valuation. *Journal of Futures Markets*, 12, 123-137.
- Hull, J. C. (2012). *Options, Futures, and other Derivatives* (8 ed.). Toronto: Prentice Hall.
- Hwang, S., & Satchell, S. E. (1998). *Implied Volatility Forecasting*. University of Warwick, Warwick Business School, Finance Group. Coventry: University of Warwick.
- Kolb, R. W. (1995). *Understanding Options*. Toronto, Canada: John Wiley & Sons.
- Kwiatkowski, D., Phillips, P. C., Schmidt, P., & Shin, Y. (1992). Testing the null hypothesis of stationarity against the alternative of a unit root. *Journal of Econometrics*, 54, 159-178.
- Merton, R. C. (1973). Theory of Rational Option Pricing. *The Bell Journal of Economics and Management Science*, 4(1), 141-183.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved