

เอกสารอ้างอิง

- จิตราพรรณ ใจคุ้ม. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงาน ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2542.
- ชัยโย กรกิจสุวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- "ตารางแสดงการจัดอันดับกลุ่มอุตสาหกรรม 20 อันดับแรก." รายงานข้อมูลสถิติประจำเดือน 29, 4 (สิงหาคม 2546): 6.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. "พฤติกรรมการส่งผ่านราคาทุ้ฤดูกาลระหว่างตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย." วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 33,3 (กันยายน-ธันวาคม 2542) : 16-51.
- ประภากร วินัยสถาพร. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นในกลุ่มพลังงานโดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- ปริญญา อิติธีการย์ชัย. การวิเคราะห์ทางเทคนิคของผลตอบแทนจากการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย : กรณีศึกษาของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงาน. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- ศิริลักษณ์ เล็กสมบุญ. การวิเคราะห์อนุกรมเวลา. มหาสารคาม : คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ, 2531.
- สัจจพันธ์ คุรุภากรณ์. ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- สุนทรา สุกันธา. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ธุรกิจเกษตรในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2545.

ภัทร์ ตั้งตระกูล. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม : กรณีศึกษา
หลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุก่อสร้างและตกแต่ง. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

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

Enders, Walter. *Applied Econometric Time Series*. New York: John Willey & Sons, 1995.

Engle, R.F.; Liliien, D and Robins, R.P. "Estimating Time Varying Risk Premia in the Term
Structure: The ARCH-M model." *Econometrica* 55(1987): 391-407.

Damodar N. Gujarati. *Basic Econometrics*, 4th ed. New York : McGraw – Hill International,
2003.

Reuters. 2004. Reuters Kobra™ Version 3.5.1. [Online]. Available: Finance and
Investment Center, Chiang Mai University, 8 January 2004.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved