

## เอกสารอ้างอิง

- กรรณิการ์ ไชยลังกา. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ธนาคารพาณิชย์ขนาดกลางในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เขมิกา ฤกษ์วันเพ็ญ. 2547. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการส่งออกและการขยายตัวทางเศรษฐกิจของประเทศไทย โดยใช้วิธีเกรงเกอร์คอแซลลิตี้. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จาตุรนต์ ฟิงพุทธรักษ์. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นธนาคารพาณิชย์ขนาดกลางโดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2543. การลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 3. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ชวินทร์ ลีนาบรรจง. 2539. ประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวมในประเทศไทย 2535-2538. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ทมาภรณ์ กองแก้ว. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. "พฤติกรรมการส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดระหว่างตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย." วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 3 (กันยายน-ธันวาคม): 16-51
- ประพนธ์ เฉลิมพิชัย. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เพชร ชุมทรัพย์. 2538. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 9. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ยุทธนา เรือนสุภา. 2543. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- เยาวลักษณ์ อรุณมีศรี. 2534. การลงทุนในหลักทรัพย์ของชาวต่างประเทศในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์.
- รังสรรค์ หทัยเสรี. 2538. "Cointegration and Error Correction Approach ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของไทย." วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ 3 (กันยายน): 20-39.
- สุธีรา ตั้งตระกูล. 2540. ความสามารถในการพยากรณ์ของการวิเคราะห์ทางเทคนิคและทางเศรษฐศาสตร์ของการเคลื่อนไหวของราคาหุ้นกลุ่มธนาคารและกลุ่มเงินทุนและหลักทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์. 2547. แบบรายงาน 56-1. แหล่งที่มา: [http://www.set.or.th/static/company/f56\\_thai\\_sec.html](http://www.set.or.th/static/company/f56_thai_sec.html). 31 ธันวาคม 2547.
- อัครา วงศ์วิจิตร. 2546. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจและการส่งออกของไทย อินโดนีเซีย มาเลเซีย และเกาหลีใต้. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Akaike, H. 1969. "Information Theory and an Extension of the Maximum Likelihood Principle." In **Second International Symposium on Information Theory**. Edited by Petrov and F. Csake. Budapest: Akademiai Kiado.
- Box, G., G. Jenkins and G. Reinsel. 1994. **Time Series Analysis**. Englewood Cliffs, NJ: Prentice Hall.
- Bollerslev, T. 1986. "Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity." **Journal of Econometrics** 31 : 307-327.
- Charemza, Wojciech W. and Deadman, Derek F. 1992. **New Directions in Econometrics: General to Specific Modeling, Cointegration and Vector Autoregression**. Aldershot: Edward Elgar.
- Clardia, Richard H. and Taylor, Mark P. 1997. "The Structure of Forward Exchange Premiums and the Forecastability of Spot Exchange Rates: Correcting the Errors." **The Review of Economics and Statistics** 3 (August): 353-361.
- Dickey, D. and W. Fuller. 1979. "Distribution of the Estimates for Autoregressive Time Series with Unit Root." **Journal of the American Statistical Association** 74 : 427-431.

- Dickey, D. and W. Fuller. 1981. "Likelihood Ratio Statistics for Autoregressive Time Series with a Unit Root," **Econometrica** 49 : 1057–1072.
- Engle, R. 1982. "Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimates of the Variance of the United Kingdom Inflation," **Econometrica** 50 : 987-1008.
- Enders, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series**. New York: John Wiley & Sons: 221-375.
- Fisher, Donald E. and Jordan, Ronald J. 1995. **Security Analysis and Portfolio Management**. Englewood Cliffs, NJ: Prentice - Hall.
- Gujarati, D. 1995. **Basic Econometrics**. 3<sup>rd</sup> ed. New York: McGraw-Hill.
- Granger, G.W.J. "Investigating Causality Relations by Econometric Models and Cross Spectral Methods." **Econometrica**. July (1969): 424-438.
- Granger, G.W.J. and P. Newbold. 1974. "Spurious Regression in Econometrics." **Journal of Econometrics** 2 : 111-120.
- Harris, R.I.D. 1957. **Using Cointegration Analysis in Econometric Modelling**. London: Prentice - Hall.
- Hsiao, C. (1981). "Autoregressive Modeling of Canadian Money and Income Data". **Journal of the American Statistical Association**. 74 : 553-560.
- Johnston, Jack and DiNardo, John. 1997. **Econometric Methods**. New York: McGraw - Hill.
- Reuters. 2004. **Reuters Kobra 3.5.1**. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 29 December 2004.