

เอกสารอ้างอิง

“ข่าวการเงิน.” การเงินการธนาคาร 23, 272(ธันวาคม 2547): 56-65

กมล ตักกะโต. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มขนส่งด้วยวิธีการเส้น
พหุคูณเชิงเส้น. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547.

กระทรวงคมนาคม. สถิติการขนส่ง. แหล่งที่มา: [http://www.motc.go.th/ Stats/stats2.htm](http://www.motc.go.th/Stats/stats2.htm)
25 ธันวาคม 2547.

จิรัตน์ สังข์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2542

ชัยโย กรกิจสุวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานใน
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. รายชื่อหลักทรัพย์ที่ใช้ในการคำนวณดัชนี SET 50 เดือน
กรกฎาคม-ธันวาคม 2547. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th>. 27 ตุลาคม 2547.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารีย์ วิบูลย์พงศ์. “พฤติกรรมการณ์ส่งผ่านราคาหุ้นในตลาด
ค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 33, 3(กันยายน-ธันวาคม 2542): 16-51

ปาริฉัตร รัตนพัวพันธ์. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม : กรณีศึกษาหลัก
ทรัพย์ในกลุ่มพลังงาน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัย
เชียงใหม่, 2547.

ภัทร์ ตั้งตระกูล. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม : กรณีศึกษาหลักทรัพย์
ในกลุ่มวัสดุก่อสร้างและตกแต่ง. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

เขวาลักษณ์ จันทร์ดี. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม : กรณีศึกษาหลัก
ทรัพย์ในกลุ่มสื่อสาร. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัย
เชียงใหม่, 2547.

- รุ่งระวี สิทธิกร. การวิเคราะห์ความเล็ง และผลตอบแทนของหลักทรัพย์ขนส่งในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชันของโจแฮนเซน. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. การวิเคราะห์อนุกรมเวลา: ตำราประกอบการเรียนวิชาอนุกรมเวลาและเลขดัชนี. มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัย ศรีนครินทรวิโรฒมหาสารคาม, 2531.
- สถาบันพัฒนาบุคลากรธุรกิจหลักทรัพย์. เงินทองต้องใส่ใจ. กรุงเทพฯ: ฝ่ายสื่อสิ่งพิมพ์ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย, 2545.
- สธนพล วิเชียรรัตนพันธ์. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการซื้อมั: กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547.
- Bollerslev, Tim. "Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity." **Journal of Econometrics** 31(1986): 307-32
- Brailsford, Timothy. "Market Closures and Time-Varying Volatility in the Australian Equity Market." **Journal of Empirical Finance** 2(1995): 165-172
- Enders, Walter. **Applied Economic 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
- Reuters. 2004. **Reuters Kobra™ Version 3.5.1**. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University, 27 December 2004.