

เอกสารอ้างอิง

- กรรณิการ์ ไชยลังกา. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ธนาคารพาณิชย์ขนาดกลางในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทริเกรชั่น. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2544. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 4 กรุงเทพฯ : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ณรงค์ศักดิ์ วงศ์สิทธิกร. 2540. การวิเคราะห์ทางเศรษฐศาสตร์ที่เกี่ยวข้องการออกหุ้นสามัญ หุ้นกู้ หุ้นกู้ควอเตอร์แรนท์ และหุ้นกู้แปลงสภาพ. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ณวรา สกุล ณ มครา. 2540. ความสามารถในการพยากรณ์ของแบบจำลองการประเมินราคาควอเตอร์แรนท์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2548. คำศัพท์หุ้นน่ารู้. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- _____. 2548. **investment Info**. แหล่งที่มา <http://www.set.or.th> 5 กุมภาพันธ์ 2548.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2548. เอกสารประกอบการสอนวิชาเศรษฐมิติ. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. “พฤติกรรมการณ์ส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่. (กันยายน-ธันวาคม): 16-51.
- ทัศนัย วรรณนวิจิตร. 2538. การประเมินราคาใบสำคัญแสดงสิทธิ. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปฎุ ปานทอง. 2548. การประมาณค่าความผันผวนของราคาหุ้นด้วยวิธีการสำหรับการประเมินค่าราคาใบสำคัญแสดงสิทธิโดยแบบจำลองแบบลิกโซลส์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- มยุรี พรพุดิพันธุ์. 2540. การประเมินราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์โดยวิธีโคอินทริเกรชั่น. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- เยาวลักษณ์ อรุณมีศรี. 2534. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สันติ ธีรพัฒน์. 2536. “พฤติกรรมของราคาออร์เรนจ์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.”
วารสารเศรษฐศาสตร์จุฬาลงกรณ์ 5, 1(มกราคม): 3-33.
- สุชาติ ธนฐิติพันธ์. 2548. การประเมินมูลค่าราคาใบสำคัญแสดงสิทธิโดยแบบจำลองแบล็คโพลล์.
การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สุโลจน์ ศรีแก้ว. 2535. การวิเคราะห์หุ้นกลุ่มธนาคารและกลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์
เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Akaike, H. 1969. “Statistical Predictor Identification.” **Annals of the Institute of Statistical
Mathematics** 21: 203-217.
- Enders, W. 1995. **Applied Econometric Time Series**. New York: John Wiley & Sons.
- Hsiao, Cheng. 1981. “Autoregressive Modelling and Money-Income Causality Detection.”
Journal of Monetary Economics 7 (January): 85-108.