

บรรณานุกรม

- กำชัย แก้วร่วมวงศ์. 2539. การวิเคราะห์เปรียบเทียบผลการตอบแทนการลงทุนหุ้นกลุ่มพลังงาน และการสื่อสาร. วิทยานิพนธ์บริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2540. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- เจน ประสิทธิ์ล้ำค่า. 2526. พฤติกรรมการเคลื่อนไหวของราคาหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. "พฤติกรรมการส่งผ่านราคาหุ้นระหว่าง ตลาดค้าส่งโตเกียวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย." วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 3 (กันยายน-ธันวาคม): 16-51.
- _____. 2543. "การประมาณค่า Stochastic Production Frontier ภายใต้ฟังก์ชันการตัดสินใจ เล็กผลผลิต." วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 2 (พฤษภาคม-สิงหาคม): 33-38
- ทรงศิริ แต่สมบัติ. 2541. การวิเคราะห์การถดถอย. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัย เกษตรศาสตร์.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2545. "รายงานประจำปี 2544." [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th> 6 มกราคม 2545.
- _____. เส้นทางการลงทุน. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th> 6 มกราคม 2545.
- _____. 2545. แบบแสดงรายการข้อมูลประจำปี 2544 (แบบ 56-1). [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th> 6 มกราคม 2545.
- นภคณ เล็กสวัสดิ์. 2543. อนุกรมเวลา. เชียงใหม่: ภาควิชาสถิติ คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- น้ำฝน เสนางคนิกร. 2544. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาด หลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- บุญชัย เกียรติธนาวิทย์. 2534. ปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีอิทธิพลต่อราคาหุ้นกลุ่มธนาคารพาณิชย์ และบริษัทเงินทุนหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- บริษัท ศูนย์วิจัย ไทยพาณิชย์ จำกัด. สรุปลักษณะธุรกิจปี 2543 และ แนวโน้มปี 2544-2545. กรุงเทพฯ : บริษัท ศูนย์วิจัย ไทยพาณิชย์ จำกัด.

- บริษัทกิมเอ็ง (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน). 2546. บทวิเคราะห์. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: http://www.kimeng.co.th/research_info/company_focus/energy 27 กุมภาพันธ์ 2546.
- ปวีณา คำพุกกะ. 2544. การวิเคราะห์ดัชนีหุ้นไทยโดยวิธีการถดถอยแบบสวิซิง. การค้นคว้าแบบอิสระวิทยาศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- พรทิพย์ เชื้อระวีวิทย. 2544. ตลาดการเงินและสถาบันการเงิน. เชียงใหม่: โรงพิมพ์ครองช่าง.
- เพชร ชุมทรัพย์. 2540. หลักการลงทุน. กรุงเทพฯ: มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- มนตรี พิริยะกุล. 2539. เทคนิคการวิเคราะห์สมการถดถอย. กรุงเทพฯ: ภาควิชาสถิติ คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยรามคำแหง.
- ยุทธนา เรือนสุภา. 2543. การวิเคราะห์ความเสถียรและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- รัชนี้ ตียพันธ์. 2543. การวิเคราะห์ด้วยเรเกสชัน. เชียงใหม่: ภาควิชาสถิติ คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วันรักษ์ มิ่งมณีนาคิน. 2540. พจนานุกรมศัพท์เศรษฐศาสตร์. พิมพ์ครั้งที่ 5. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ศิริลักษณ์ สุวรรณวงศ์. 2535. การวิเคราะห์อนุกรมเวลา. พิมพ์ครั้งที่ 1. กรุงเทพฯ: ชมรมเด็ก.
- หทัยรัตน์ บุญโญ. 2541. การประมาณค่าเบต้าในแบบจำลองการกำหนดราคาสินทรัพย์ประเภทหุ้น. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อัญญา ชันชวิทย์. 2541. การวิเคราะห์การลงทุนในตราสารหนี้. โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- อำนาจ ลีชาติพิบูล. 2521. การวิเคราะห์หลักทรัพย์. โรงพิมพ์อมรินทร์การพิมพ์.
- Banz, Rolf W. 1981. "The Relationship Between Return and Market Value of Common Stocks. *Journal of Financial Economics* 9 (March):3-18 Quoted in Ravi Jagannathan and Eleen R. McGrattan. 1995. "The CAPM Debate." Federal Reserve Bank of Minneapolis Quarterly Review 19 (Fall): 2-17.
- Black, Fischer; Jensen, Michael C. and Scholes, Myron. 1972. "The Capital Asset Pricing Model: Some empirical tests. In *Studies in the theory of capital markets.*" Edited By Michael Jensen, pp 79-121. New York: Praeger. Quoted in Ravi Jagannathan and Eleen R. McGrattan. The CAPM Debate. Federal Reserve Bank of Minneapolis Quarterly Review 19 (Fall): 2-17.

- 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. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงษ์. 2545. การประยุกต์เศรษฐมิติสำหรับเศรษฐศาสตร์เกษตร. [เชียงใหม่: ม.ป.พ].
- Dickey, D. and W. Fuller. 1981. "Likelihood Ratio Statistics for Autoregressive Time Series with a Unit Root," *Econometrica* 49: 1057-1072. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงษ์. 2545. การประยุกต์เศรษฐมิติสำหรับเศรษฐศาสตร์เกษตร. [เชียงใหม่: ม.ป.พ].
- Enders, W. 1995. *Applied Econometric Time Series*. New York : Iowa State University.
- Fabozzi, F.J. and Francis, J.C. "Stability Tests for Alphas and Betas Over Bull and Bear Market Conditions." *The Journal of Finance* 322 , 4 (September 1979): 1093-1099 อ้างถึงใน ทนทัษร์ตัน บุญโญ. 2541. การประมาณค่าแบบจำลองการกำหนดราคาสินทรัพย์ประเภททุน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Fischer, Donald and Jordan, Ronald J. 1995. *Securities Analysis and Portfolio Management*. 6th ed. Englewood Cliffs, NJ: Prentice Hall International.
- Heckman, J. 1976. "The Common Structure of Statistical Models of Truncation. Sample Selection and Limited Dependent Variables and a Simple Estimator for Such Models." *Annals of Economic and Social Measurement* 5: 475-492. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงษ์. 2545. การประยุกต์เศรษฐมิติสำหรับเศรษฐศาสตร์เกษตร. [เชียงใหม่: ม.ป.พ].
- Henriksson, Roy D. and Merton, R.C. 1981. "On Market Timing and Investment Performance II. Statistical Procedures for Evaluating Forecast Skill." *Journal of Business* 54 (October 1981): 513-533. อ้างถึงใน จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2540. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- Lee, L.F. 1978. "Unionism and Wage Rates : A Simultaneous Equations Model with Qualitative and Limited Dependent Variables." *International Economics Review* 19: 415-433. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงษ์. 2545. การประยุกต์เศรษฐมิติสำหรับเศรษฐศาสตร์เกษตร. [เชียงใหม่: ม.ป.พ].

- Lee, L.F., G.S. Maddala, and R. P. Trost. 1980. "Asymptotic Covariance Matrices of Two-Stage Probit Two-Stage Tobit Methods for Simultaneous Equations Models with Selectivity." *Econometrica*. 48 : 491-503. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2545. การประยุกต์เศรษฐมิติสำหรับเศรษฐศาสตร์เกษตร. [เชียงใหม่: ม.ป.พ].
- Levy, Haim. 1996. *Introduction to Investments*. Cincinnati: South-Western College.
- Maddala, G.S. 1986. *Limited-Department and Qualitative Variables in Econometrics*. New York: Cambridge University Press.
- Maddala, G.S. and Kim, In-Moo. 1998. *Unit Roots Cointegration and Structural Change*. New York: Cambridge University Press.
- Merton, R.C. 1981. On Market Timing and Investment Performance: An Equilibrium Theory of Value for Market Forecast. *Journal of Business* 54 (July 1981): 363-406. อ้างถึงใน จิรัตน์ สังข์แก้ว. (2540). การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- Reuters. 2002. *Reuters Kobra 3.5.1*. [Online]. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 6 December 2002.
- Said, S. and D. Dickey. 1984. "Testing for Unit Roots in Autoregressive - Moving Average Models with Unknown Order." *Biometrice* 71: 599-607. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2545. การประยุกต์เศรษฐมิติสำหรับเศรษฐศาสตร์เกษตร. [เชียงใหม่: ม.ป.พ].
- Sharpe, William F. and Alexander, Gordon J. 1990. *Investments*. 4th ed. Englewood Cliffs, NJ: Prentice- Hall International.
- Wiggins, J.B. "Betas in Up and Down Markets." *The Financial Review* 27, 1 (February 1992) 107-123. อ้างถึงใน หทัยรัตน์ บุญโง. 2541. การประมาณค่าเบต้าในแบบจำลองการกำหนดราคาสินทรัพย์ประเภททุน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

.....