

เอกสารอ้างอิง

- กำชัย แก้วร่วมวงศ์. การวิเคราะห์เปรียบเทียบผลการตอบแทนการลงทุนหุ้นกลุ่มพลังงานและการสื่อสาร. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ขวัญหล้า จันทะพันธ์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2542.
- เดชวิทย์ นิลวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสาร. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539. ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2546. Market Statistics : Statistical Highlights of The Stock Exchange of Thailand & The Market for The Alternative Investment เดือนมกราคม 2547. [ออนไลน์].
แหล่งที่มา: http://www.set.or.th/static/market/market_u13.html. 9 กุมภาพันธ์ 2547.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. "พฤติกรรมการส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย." วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 33, 3 (กันยายน-ธันวาคม 2542): 16-51.
- นารุญา ยนเปี่ยม. หลักการลงทุน. กรุงเทพฯ: พี.เอ็น.การพิมพ์, 2538.
- ภัทร์ ตั้งตระกูล. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเื่อม: กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุก่อสร้างและตกแต่ง. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- เยาวลักษณ์ อรุณมีศรี. การลงทุนในหลักทรัพย์ของชาวต่างประเทศในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์, 2534.
- ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. การวิเคราะห์อนุกรมเวลา. มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒมหาสารคาม, 2531.

สถาบันพัฒนาบุคลากรธุรกิจหลักทรัพย์. 2545. **เงินทองต้องใส่ใจ**. กรุงเทพฯ: ฝ่ายสื่อสิ่งพิมพ์ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

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

Damodar, E. Gujarati. *Basic Econometrics*, 4th ed. New York : McGraw-Hill International, 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.

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

Patterson, Kerry. *An Introduction to Applied Econometrics: A Time Series Approach*. London, 2000.

Reuters. 2003. Reuters Kobra™ Version 3.5.1. [Online]. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 22 December 2003.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved