

เอกสารอ้างอิง

- กรรณิการ์ ไชยลังกา. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ธนาคารพาณิชย์ขนาดกลางในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- กฤษณา เสกตระกูล. ความสัมพันธ์ระหว่างปริมาณเงินและรายได้ : การทดสอบ Money – Income Causality กรณีของประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2534.
- กำชัย แก้วร่วมวงศ์. การวิเคราะห์เปรียบเทียบผลการตอบแทนการลงทุนหุ้นกลุ่มพลังงานและการสื่อสาร. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ขวัญหล้า จันทะพันธ์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- เขมิกา ฤกษ์วันเพ็ญ. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการส่งออกและการขยายตัวทางเศรษฐกิจของประเทศไทย โดยวิธีแองเกอร์คอแชลลิตี้. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547.
- เจน ประสิทธิ์ล้ำคำ. พฤติกรรมการเคลื่อนไหวของราคาหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2526.
- จาดุรันต์ พึ่งพุทธรักษ์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของธนาคารพาณิชย์ขนาดกลางโดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- เดชวิทย์ นิลวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ทมาภรณ์ กองแก้ว. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

- ปวีณา คำพุกกะ. การวิเคราะห์ดัชนีหุ้นไทยโดยวิธีการถดถอยแบบสวิตซิง. วิทยานิพนธ์
วิทยาศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2545.
- พรรณี อิศรพงศ์ไพศาล. การเลือกลงทุนซื้อหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2520.
- พัชรี เหลืองรุ่งโรจน์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นในกลุ่มสื่อสารโดยวิธีการถดถอยแบบสลับ
เปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- เยาวลักษณ์ อรุณมีศรี.. การลงทุนในหลักทรัพย์ของชาวต่างประเทศในตลาดหลักทรัพย์แห่ง
ประเทศไทย. วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์, 2534.
- รังสรรค์ หทัยเสรี. "Cointegration and Error Correction Approach :
ทางเลือกใหม่ในการ ประยุกต์ใช้แบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของประเทศไทย."
วารสารเศรษฐศาสตรธรรมศาสตร์ 13 (13 กันยายน 2538) : 20-55.
- วรวิทย์ พรพิมลมิตร. ความสัมพันธ์ระหว่างการเจริญเติบโตของการส่งออกกับการเจริญเติบโตทาง
เศรษฐกิจ กรณีศึกษากลุ่มอาเซียน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2542.
- วิชัย ศรีศักดิ์สุวรรณ. การส่งออก การเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจ และความสัมพันธ์แบบเป็นเหตุเป็น
ผล ศึกษากรณีประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์
มหาวิทยาลัย, 2536.
- สุนทรา สุนกันธา. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ธุรกิจเกษตรในตลาดหลักทรัพย์แห่ง
ประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- สุโลจน์ ศรีแก้ว. การวิเคราะห์หุ้นกลุ่มธนาคารและกลุ่มทุนหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2535.
- โสภณ ด่านศิริกุล. คัมภีร์หุ้น. กรุงเทพฯ : ส. เอเชีย เพรส, 2545.
- เอนก อุปรา. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มบันเทิงและสันทนาการ
โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547.
- อัครา วงศ์วิจิตร. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจและการส่งออก
ของไทย อินโดนีเซีย มาเลเซีย เกาหลีใต้. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

โอฬาร ไชยประวัตติ. “ก้าวต่อไปของ 5 ปี Investment Project.” การใน เอกสารประกอบสัมมนา เรื่อง ก้าวต่อไปของ 5 ปี Investment Project. ณ คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547.

Akaike, H. “Statistical Predictor Identification.” **Annals of the Institute of Statistical Mathematics** 21: 203-217.

Cheng Hsiao, “Autoregressive Modelling and Money-Income Causality Detection.” **Journal of Monetary Economics** 7(January 1981): 85-108.

Dickey, D., & Fuller, W.A. “Distribution of the Estimators for Autoregressive Time Series with a Unit Root.” **Journal of American Statistics Association** 74 (1979): 427–431.

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

Engle, Robert E. and Granger, Clive W.J. “Cointegration and Error-Correction : Representation, and Testing.” **Econometrica** 55 (March 1987): 251-276.

Fischer, Donald E. And Jordan, Ronald S. **Securities Analysis and Portfolio Management**. New York: Prentice–Hall, 1995.

Ghartey, Edward E. “Causal Relationship Between Exports and Economic Growth : Some Empirical Evidence in Taiwan, Japan, and the U.S.” **Applied Economics** 25 (1993): 1145-1152.

Granger, C.W.J. “Investigating Causality Relations by Econometric models and Cross-Spectral Methods.” **Econometrica** July (1969): 424-438.

Gujarati, D. **Basic Econometrics**. 3rd ed. New York: McGraw-Hill, 1995.

Rangsan Hataiseree. “Vector Autoregression, Unit Roots, Cointegration and Error-Correction Mechanism.” A General Overview.” **Chulalongkorn Journal of Economics** 8 (May 1996): 263-294.

Hsiao, Cheng. “Autoregressive Modelling and Money-Income Causality Detection.” **Journal of Monetary Economics** 7 (January 1981): 85-106.

Hsiao, W. Mci-chu. “Tests of Causality and Exogeneity Between Exports and Economic Growth : The Case of Asian NICs.” **Journal of Economic Development** 12 (1987): 148-159.

Johansen, Soren and Juselius, Katerina “Maximum Likelihood Estimation and Inference on Cointegration with Application to the Demand for Money.” **Oxford Bulletin of Economics and statistics** 52 (1990), 196-209.

Johnston and Dinardo. **Econometric Methods**. 4th ed. New York : McGraw-Hill, 1997.

Jung, Woo S., and Marshall, Peyton J. "Export, Growth and Causality in Developing Countries."

Journal of Development Economics 18 (1985): 1-12.

Lee, S. Y. and Li, W. K. "Money, Income and Prices and their Lead Lag Relationship in

Singapore." **Singapore Economic Review** 28-29 (1983-1984): 73-87.

MacKinnon, J.G. "Critical Values for Cointegration Tests." **Long run Economic Relationships**.

Oxford University (1991): 267-276.

Pindyck, Robert S. and Rubinfeld, Daniel L. **Econometric Models and Economic Forecasts**.

Singapore: McGraw-Hill, 1998.

Rahman and Mustafa . "Dynamics of Real Exports and Real Economic Growths in 13 Selected

Asian Countries." **Journal of Economic Development** 22 (December 1997): 81-84.

Reuters, **Reuters Kobra 3.5.1**. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University.

26 December 2004.