

## เอกสารอ้างอิง

- กรรณิการ์ ไชยลังกา. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์  
ธนาคารพาณิชย์ขนาดกลางในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน.  
การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เขมิกา ฤกษ์วันเพ็ญ. 2547. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการส่งออกและการขยายตัวทาง  
เศรษฐกิจของประเทศไทย โดยใช้วิธีแครงเกอร์คอแซลลิตี้. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร  
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จาดูรันต์ พึ่งพุทธรักษ์. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นธนาคารพาณิชย์ขนาดกลางโดย  
วิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2543. การลงทุน. พิมพ์ครั้งที่3. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- เจน ประสิทธิ์ล้ำค่า. 2526. พฤติกรรมการเคลื่อนไหวของราคาหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ชวินทร์ ลีนาบรรจง. 2539. ประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวมในประเทศไทย 2535-2538.  
วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ทมาภรณ์ กองแก้ว. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์  
ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน.  
การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. “พฤติกรรมการส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดระหว่าง  
ตลาดค้าส่งโตเกียวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 3(กันยายน-ธันวาคม): 16-15.
- บริษัท ศูนย์วิจัยกสิกรไทย จำกัด. 2549. CEIC Database [ฐานข้อมูล]. กรุงเทพฯ: บริษัท ศูนย์วิจัย  
กสิกรไทย จำกัด
- บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน). 2549. BISNEWS APEX from Reuters [ฐานข้อมูล].  
กรุงเทพฯ: บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)

- ประพนธ์ เถลิ้มพิชัย. 2546. การวิเคราะห์ความเสถียรและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เพชร ชุมทรัพย์. 2538. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่3. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ยุทธนา เรือนสุภา. 2543. การวิเคราะห์ความเสถียรและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เขवालักษณ์ อรุณมีศรี. 2534. การลงทุนในหลักทรัพย์ของชาวต่างประเทศในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์.
- รังสรรค์ หทัยเสรี. 2538. “Cointegration and Error Correction Approach ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ 3(กันยายน): 20-39.
- สุธีรา ตั้งตระกูล. 2540. ความสามารถในการพยากรณ์ของการวิเคราะห์ทางเทคนิคและทางเศรษฐศาสตร์ของการเคลื่อนไหวของราคารัฐมนตรีและกลุ่มเงินทุนและหลักทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Akaike, H. 1969. “Information Theory and an Extension of the Maximum Likelihood Principle.” In **Second International Symposium on Information Theory**. Edited by B. Pterv and F. Csake. Budapest: Akademiai Kiado.
- Bollerslev, T. 1986. “Generalized Autoregressive Condition Heteroscedasticity.” **Journal of Econometrics** 31: 307-327
- Box, G.; Jenkins, G. and Reinsel, G. 1994. **Time Series Analysis**. Englewood Cliffs, NJ: Prentice Hall.
- Charemza, Wojciech W. and Deadman, Derek F. 1992. **New Directions in Econometrics: General to Specific Modeling, cointegration and Vector Autoregression**. Aldershot: Edward Elgar.
- Clardia, Richard H. and Taylor, Mark P. 1997. “The Structure of Forward Exchange Premiums and the Forecast Ability of Spot Exchange Rates: Correcting the Error.” **The Review of Economics and Statistics** 3 (August): 353-361.

- Dickey, D. and Fuller, W. 1979. "Distribution of the Estimates for Auto regression Time Series with Unit Root." **Journal of the American Statistical Association** 74 : 427-431.
- \_\_\_\_\_. 1981. "Likelihood Ratio Statistics for Auto regression Time Series with Unit Root." **Econometrics** 50: 987-1008.
- Enders, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series**. New York: John Wiley & Sons.
- Engle, Robert E. and Granger, Clive W.S. 1995. "Cointegration and Error-Correction: Representation, Estimation, and Testing." **Econometrics** 55 (March): 251-276
- Fisher, Donald E. and Jordan, Ronald J. 1995. **Security Analysis and Portfolio Management**. Englewood Cliffs, NJ: Prentice-Hall.
- Granger, G.W.J. and Newbold, P. 1974. "Spurious Regression in Econometrics." **Journal of Econometrics** 2: 111-120.
- Gujarati, D. 1995. **Basic Econometrics**. 3<sup>rd</sup> ed. New York: McGraw-Hill.
- Harris, R.I.D. 1957. **Using Cointegration Analysis in Econometric Modeling**. London: Prentice-Hall.
- Hsiao, C. 1981. "Autoregression Modeling of Canadian Money and Income Data." **Journal of the American Statistical Association** 74: 553-560.
- Johnston, Jack and DiNardo, John. 1997. **Econometric Methods**. New York: McGraw-Hill.