

เอกสารอ้างอิง

ชัยโย กรกิจสุวรรณ. 2540. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2551. การให้บริการข้อมูล. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th>
ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2548. เอกสารประกอบการสอนวิชาเศรษฐมิติ. เชียงใหม่ : คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ธนิดา กาญจนพันธ์. 2534. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาหุ้นของกลุ่มหลักทรัพย์แต่ละกลุ่มกับตัวแปรทางเศรษฐกิจมหภาค – จุลภาค. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

น้ำฝน เสนาคนิกร. 2544. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

บริษัท หลักทรัพย์กิมเอ็ง (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน). 2551. ข้อมูลเกี่ยวกับหุ้น. แหล่งที่มา: <http://kimeng.co.th>

สัจจพันธุ์ ตูร์ภูภรณ์. 2540. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

Barnes, Michelle L. & Hughes, Anthony W. (2002): “A Quantile Regression Analysis of the Cross Section of Stock Market Returns”, Working Paper, *FRB Boston Series*, No. 02-2, <http://www.bos.frb.org/economic/econbios/barnes.htm#publications>.

Chukiat Chaiboonsri and Songsak Sriboonchitta and Prasert Chhaitip(2009). **International Tourists Spending in Thailand: Quantile Regression and Inter-Quantile Regression Approach**. Researcher, Faculty of Economics, Chiang Mai University, Chiang Mai Thailand.

Demirer, Riza & Kutan, Ali M. (2006): “Does Herd Behavior Exist in Chinese Stock Markets?”, *International Financial Markets, Institutions and Money*, Vol. 16, pp. 123-142.

Greene, William H. 2003. **Econometric Analysis**. 5th ed. New Jersey: Prentice Hall

Hwang, Soosung & Salmon, Mark (2004): “Market Stress and Herding”, *Journal of Empirical*

Finance, Vol. 11, pp. 585-616. Saastamoinen Jani (2008). **QUANTILE**

REGRESSION ANALYSIS OF DISPERSION OF STOCK RETURNS -

EVIDENCE OF HERDING. University of Joensuu, Economics and Business

Administration, P.O. Box 111, FI-80101 JOENSUU, FINLAND; e-

mail: jani.saastamoinen@joensuu.fi. Judge, George, et al. 1988. **Introduction to the**

Theory and Practice of Econometrics. 2nd ed. New York: John Wiley and Sons

Hwang, Soosung & Salmon, Mark (2006): “Sentiment and Beta Herding”, Conference

Paper. <http://www2.warwick.ac.uk/fac/soc/wbs/research/wfri/prog2005>

/behaviouralfinance1day.

Koenker, Roger and Jose A. F. Machado (1999). “Goodness of Fit and Related Inference

Processes for Quantile Regression,” *Journal of the American Statistical Association*,

94(448), 1296-1310.

Koenker, Roger & Hallock, Kevin F. (2001): “Quantile Regression: An Introduction”,

<http://www.econ.uiuc.edu/~roger/research/intro/rq.pdf>.

Koenker, Roger (2005). *Quantile Regression*. New York: Cambridge University Press

Michelle L. Barnesal and Anthony W. Hughesb(2002). **A Quantile Regression Analysis of the**

Cross Section of Stock Market Returns. aFederal Reserve Bank of Boston, T-8,

Research600 Atlantic Avenue, Boston, MA 02106 USA bSchool of Economics,

University of Adelaide Adelaide, SA5005 Australia

Scharfstein, David S. & Stein, Jeremy C. (1990): “Herd Behavior and Investment”, *The American*

Economic Review, Vol. 80, No. 3.

Thierry Post and Pim Van Vliet (2007). **Conditional Downside Risk and the CAPM.** ERS-

2004-048-F&A, from <http://www.erm.nl>.