

เอกสารอ้างอิง

- กำชัย แก้วร่วมวงศ์. การวิเคราะห์เปรียบเทียบผลการตอบแทนการลงทุนหุ้นกลุ่มพลังงานและการ
สื่อสาร. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- เขมิกา ฤกษ์วันเพ็ญ. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการส่งออกและการขยายตัวทาง
เศรษฐกิจของประเทศไทย โดยใช้วิธีเกรงเกอร์คอแซลลิตี้. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547.
- ชัยโย กรกิจสุวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานใน
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- เดชวิทย์ นิลวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาด
หลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. “พฤติกรรมการส่งผ่านราคาทุ้งทุคาต่อระหว่างตลาดค้าส่ง
โตเกียวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
3 (กันยายน-ธันวาคม 2542): 16-51.
- น้ำฝน เสนางคนิกร. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่ง
ประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิตมหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- พรชัย จิรวินิจนันท์. การประยุกต์ใช้ทฤษฎี CAPM กับหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
ภาคนิพนธ์คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์.
มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2535.
- พรรณิ อิศรพงศ์ไพศาล. การเลือกลงทุนซื้อหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2520.
- พัชรี เหลืองรุ่งโรจน์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นในกลุ่มสื่อสารโดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน.
การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

- เขาวัดกษณ์ อรุณมีศรี. การลงทุนในหลักทรัพย์ของชาวต่างประเทศในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์, 2534.
- วรวิทย์ พรพิมลมิตร. ความสัมพันธ์ระหว่างการเจริญเติบโตของการส่งออกกับการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจ กรณีศึกษากลุ่มอาเซียน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2542.
- วิชัย ศรีสุวรรณ. การส่งออก การเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจ และความสัมพันธ์แบบเป็นเหตุเป็นผล ศึกษากรณีประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2536.
- สุโลจน์ ศรีแก้ว. การวิเคราะห์หุ้นกลุ่มธนาคารและกลุ่มทุนหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2535.
- อัครา วงศ์วิจิตร. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจและการส่งออกของ ไทย อินโดนีเซีย มาเลเซีย เกาหลีใต้. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- Akaike, H. "Fitting Autoregressions for Prediction." **Annals of the Institute of Statistical Mathematics** 21: 243-247.
- Akaike, H. "Statistical Predictor Identification." **Annals of the Institute of Statistical Mathematics**
- 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 Forecastability of Spot Exchange Rates: Correcting the Errors." **The Review of Economics and Statistics** 3 (August): 353-361.
- Enders, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series.** New York: John Wiley & Sons.
- Engle, Robert E. and Granger, Clive W.J. "Cointegration and Error-Correction : Representation, and Testing." **Econometrica** 55 (March 1987): 251-276.
- Fisher, Donald E. and Jordan, Ronald J. 1995. **Security Analysis and Portfolio Management.** Englewood Cliffs, NJ: Prentice - Hall.

- 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.
- Harris, R.I.D. 1957. **Using Cointegration Analysis in Econometric Modelling**. London: Prentice - Hall.
- Hataiseree, R. "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.
- Johnston, Jack and DiNardo, John. 1997. **Econometric Methods**. New York: McGraw - Hill.
- 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.
- MacKinnon, J.G. "Critical Values for Cointegration Tests." **Long run Economic Relationships**. Oxford Univercity (1991): 267-276.
- Pindyck, Robert S. and Rubinfeld, Deniel L. **Econometric Models and Economic Forecasts**. Singapore: McGraw-Hill, 1998.
- Rahman, M. and Mustafa, M. "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, 30 December 2004.