

เอกสารอ้างอิง

- จิรัตน์ สัจจ์แก้ว. 2544. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ชัยโย กรกิจสุวรรณ. 2540. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- น้ำฝน เสนางคนิกร. 2544. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- บริษัทเซทเทรดคอตคอม จำกัด. 2550. ข้อมูลการซื้อขายหลักทรัพย์. แหล่งที่มา: <http://www.setsmart.com>. (25 กุมภาพันธ์ 2550)
- บุญชัยณิศวรรค์ ชมภูคำ. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของของหลักทรัพย์บริษัทผลิตไฟฟ้าบางหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยการใช้วิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เพชร ชุมทรัพย์. 2544. หลักการลงทุน. กรุงเทพฯ: มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ยุทธนา เรือนสุภา. 2543. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ยูวดี คันทะมูล. 2548. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- รังสรรค์ หทัยเสรี. 2535. “Cointegration and Error Correction Approach: ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้แบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ ธรรมศาสตร์ 13,13 (กันยายน).

ศูนย์วิจัยกสิกรไทย. 2550. **เศรษฐกิจมหภาค**. แหล่งที่มา: http://www.kasikornresearch.com/kr/search_detail.jsp?cid=3&id=8478. (5 มกราคม 2550)

เอนก อุปรา. 2547. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มบับเท็งและสันทนาการโดยวิธีโคอินทิเกรชัน**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

Ender, W. 1995. **Applied Econometrics Time Series**. New York: John Wiley & Sons.

Fischer, Donald E. and Jordan, Ronald J. 1995. **Security Analysis and Portfolio Management**. Englewood Cliffs, NJ: Prentice – Hall.

Gujarati, Damodar N. 1995. **Basics Econometrics**. 3rd ed. New York: McGraw – Hill.

Johnston, J. and Dinardo, J. 1997. **Econometric Methods**. New York: McGraw – Hill.

Lintner, J. 1965. “The Valuation of Risk Asset and the Selection of Risky Investments in Stock Portfolios and Capital Budget.” **Review of Economics and Statistic** 47, 1 (February): 13-37.

Markowitz, Harry. 1952. “Portfolio Selection.” **Journal of Finance** 19, 7 (March): 77-91.

Mossin, Jan. 1966. “Equilibrium in a Capital Asset Market.” **Econometrica** 34, 4 (October): 768-784.

Sharpe, William F. 1964. “Capital Asset Prices: A Theory of Market Equilibrium Under Conditions of Risk.” **Journal of Finance** 19, 3 (September): 425-442.