

## เอกสารอ้างอิง

- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2007. **Fact Book 2007**. กรุงเทพฯ: สถาบันพัฒนาบุคลากร  
ธุรกิจหลักทรัพย์.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และ อารี วิบูลย์พงศ์. 2543. **การประยุกต์เศรษฐมิติสำหรับเศรษฐศาสตร์  
เกษตร**. เชียงใหม่ : คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- ภวิษฐ์พร วงศ์ศักดิ์. 2549. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของกองทุนรวมที่ลงทุนใน  
ต่างประเทศ**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- มณัฏฐ์ คงหัวรอบ. 2550. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงตามการเปลี่ยนแปลงของเวลา ของหลักทรัพย์  
ในกลุ่มเทคโนโลยีในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. การค้นคว้าแบบอิสระ  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สุริย์ วังไพบูลย์. 2552. **การวิเคราะห์อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงของการลงทุนในกองทุนรวม  
หุ้นระยะยาว**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สำนักงานคณะกรรมการกำกับและส่งเสริมการประกอบธุรกิจประกันภัย. 2552. **ข้อมูลสถิติการ  
ประกันภัยและการประกันวินาศภัย**. แหล่งที่มา <http://www.oic.or.th/th/statistics/index.php>
- ศิริกาญจน์ สุวรรณะ. 2550. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มพาณิชย์  
ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- หลักสูตรผู้เชี่ยวชาญการลงทุนในหลักทรัพย์. 2548. **เครื่องมือเพื่อการวิเคราะห์การลงทุน**. สถาบัน  
พัฒนาความรู้ตลาดทุน ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- อเนก อุปรา. 2547. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มพันธบัตรและ  
สันทนการโดยวิธีโคอินทิเกรชัน**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Box, G ; Jenkin, G. and Reinsel , G. 1994. **Time Series Analysis**. Englewood Cliffs, NJ :  
Prentice – Hall.
- Dickey, D., & Fuller, W.A. 1979. **“Distribution of the Estimators for Autoregressive Time  
Series with a Unit Root.”** Journal of American Statistics Association 74 : 427 – 431

- Fischer, Donald E. and Jordan, Ronald J. 1995. **Security Analysis and Portfolio Management**.  
New York : McGraw – Hill.
- Enders, W. 1995. **Applied Econometrics Time Series**. New York : Wiley.
- Engle, Robert E. and Grenger, Clive W.J. 1987. “Cointegration and Error Correction :  
Representation, and Testing.” **Econometrica** 55 ( March ) : 251 - 276
- Gujarati, D. 2003. **Basic Econometrics**. 4<sup>th</sup> ed. New York : McGraw – Hill.
- Greene, W. 2000. **Economic Analysis**. 4<sup>th</sup> ed. Upper Saddle River, NJ : Prentice – Hall.
- Harris, Donald E. and Jordan, Ronald J. 1995. **Security Analysis and Portfolio Management**. 6<sup>th</sup>  
ed. Englewood Cliffs : Prentice – Hall
- Johnston, J. and Dinarldo, J. 1997. **Econometric Methods**. Singapore : McGraw – Hill.
- Lintner, John. 1965. “The Valuation of Risk Asset and Selection of Risky Investment in Stock  
Portfolio and Capital Budgets.” **Review of Economics and Statistics** 47, 1( February )  
:13 - 37
- Markowitz, Harry. 1952. “Portfolio Selection.” **Journal of Finance** 7 ( March ) : 77 – 91
- Mossin, Jan. 1966. “Equilibrium in Capital Asset Market.” **Econometrica**, 34, 4 ( October ) :  
768 - 784
- Shape, William F. 1964. “Capital Asset Prices : A Theory of Market Equilibrium Under  
Condition of Risk.” **Journal of Finance** 19, 3 ( September ) : 425 – 442
- Spanos, A. 1986. **Statistical Foundation of Econometric Modeling**. Cambridge : Cambridge  
University Press.