

## บรรณานุกรม

- กัญสุดา ถิมพิพัฒนชัย. แบบจำลองเชิงเศรษฐมิติสำหรับการผลิต ตลาดแรงงานและระดับราคาของประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2543.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2540.
- ชวินทร์ ถีนานบรรจง. ประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวมในประเทศไทย 2535-2538. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2539.
- ชัยโย กรกิจสุวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- เดชวิทย์ นิลวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. “พฤติกรรมการบริโภคกุ้งสดแช่แข็งของตลาดสหรัฐอเมริกาและญี่ปุ่น.” วารสารเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 4,1(2543): 79-93.
- นภเกศน์ เอี่ยมเพชรพงศ์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนและการเลือกลงทุนในหลักทรัพย์กลุ่มสื่อสารโดยใช้แบบจำลอง CAPM: แบบฝึกหัดการวิจัยวิชา 751409. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- น้ำฝน เสนางคณิก. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- แบบรายงาน 56-1 : บริษัทบิกซี ซูเปอร์เซ็นเตอร์ จำกัด (มหาชน). [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.sec.or.th/index>. 28 มีนาคม 2546.
- แบบรายงาน 56-1 : บริษัทไมเนอร์ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน). [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.sec.or.th/index>. 28 มีนาคม 2546.
- แบบรายงาน 56-1 : บริษัทสยามแมคโคร จำกัด (มหาชน). [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.sec.or.th/index>. 28 มีนาคม 2546.

แบบรายงาน 56-1 : บริษัทสหพัฒนาพิบูล จำกัด (มหาชน). [ออนไลน์]. แหล่งที่มา:

<http://www.sec.or.th/index>. 26 เมษายน 2546.

พยชน์ หาญผดุงกิจ. อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2532.

พรชัย จิรวินิจนันท์. การประยุกต์ใช้ทฤษฎี CAPM กับหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ในตลาด

หลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. ภาคนิพนธ์คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบัน

บัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์, 2535.

พรณี อิศรพงศ์ไพศาล. การเลือกลงทุนซื้อหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2520.

พิกุล แซ่โล้ว. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มหุ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ในตลาดหลัก

ทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัย

เชียงใหม่, 2544.

พิเชษฐ พรหมผุย. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อค่าพรีเมียมและค่าชดเชยความเสี่ยงในการซื้อ

ขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัย

เชียงใหม่, 2540.

เพชร ชุมทรัพย์. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 9. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์,

2538.

พัชราภรณ์ คงเจริญ. หน่วยลงทุนในประเทศไทย อัตราผลตอบแทน ความเสี่ยง และ กลยุทธ์การ

ลงทุน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2535.

ยุทธนา เรือนสุภา. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ใน

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2543.

เขวลักษณ์ อรุณเมธีศรี. การลงทุนในหลักทรัพย์ของชาวต่างประเทศในตลาดหลักทรัพย์แห่ง

ประเทศไทย. วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชาเศรษฐศาสตร มหาวิทยาลัย

เกษตรศาสตร์, 2534.

รังสรรค์ หทัยเสรี. "Cointegration and Error Correction Approach: ทางเลือกใหม่ในการ

ประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของประเทศไทย." วารสารเศรษฐ

ศาสตรธรรมศาสตร์ 13 (2535): 20-55.

สุโลงณี ศรีแก้ว. การวิเคราะห์หุ้นกลุ่มธนาคารและกลุ่มทุนหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร

มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2535.

- หทัยรัตน์ บุญโณ. การประมาณค่าเบต้าในแบบจำลองการกำหนดราคาสินทรัพย์ประเภททุน.  
 วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2541.
- Dickey, D., & Fuller, W.A. "Distribution of the Estimators for Autoregressive Time Series  
 with a Unit Root." **Journal of American Statistics Association** 74(1979): 427-431.
- Fischer, Donald E. and Jordan, Ronald J. **Security Analysis and Portfolio Management**.  
 New York: McGraw-Hill, 1995.
- Enders, W. **Applied Econometric Time Series**. New York: Wiley, 1995.
- Engle, Robert E. and Granger, Clive W.J. "Cointegration and Error – Correction:  
 Representation, and Testing." **Econometrica** 55(March 1987): 251-276.
- Gujarati, D. **Basic Econometrics**. 3<sup>rd</sup> ed. New York: McGraw-Hill, 1995.
- Hataiseree, R. "Vector Autoregression, Unit Roots, Cointegration and Error – Correction  
 Mechanism: A General Overview." **Chulalongkorn Journal of Economics**  
 8(May 1996): 263-294.
- 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.
- Johnston, J. and DiNardo, J. **Econometric Methods**. Singapore: McGraw – Hill, 1997.
- MacKinnon, J. G. "Critical Values for Cointegration Tests." In **Long-run Economic  
 Relationships: Readings in Cointegration**. Edited by Engle, Robert F. and  
 Granger, Clive W.J. Oxford: Oxford University Press, 1991. pp. 267-276
- Maddala, G. S. and In Moo Kim. **Unit Roots Cointegration and Structural Change**.  
 New York: Cambridge University Press, 1998.
- Pindyck, Robert S. and Rubinfeld, Deniel L. **Econometric Models and Economic Forecasts**.  
 Singapore: McGraw – Hill, 1998.
- Reuters. 2003. **Reuters Kobra 3.5.1**. [Online]. Available: Finance and Investment Center,  
 Chiang Mai University 22 January 2003.
- Wolters, J. "Cointegration and German Bond Yield." **Applied Economics Letters** 5 (1998):  
 497-502.