

บรรณานุกรม

- ชวินทร์ ถีนานบรรจง. **ประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวมในประเทศไทย 2535-2538.**
วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2539.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. “พฤติกรรมการบริโภคกุ้งสดแช่แข็งของตลาดสหรัฐอเมริกาและญี่ปุ่น.” **วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่** 4,1(2543): 79-93.
- ชัยโย กรกิจสุวรรณ. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระ.
น้ำฝน เสนางคนิกร. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- แบบรายงาน 56-1 : บริษัทเงินทุนกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน).** [ออนไลน์]. แหล่งที่มา :
<http://www.sec.or.th/index>. 13 เมษายน 2546.
- แบบรายงาน 56-1 : บริษัทเงินทุนธนชาติ จำกัด (มหาชน).** [ออนไลน์]. แหล่งที่มา :
<http://www.sec.or.th/index>. 13 เมษายน 2546.
- แบบรายงาน 56-1 : บริษัทสินอุทสากรรม จำกัด (มหาชน).** [ออนไลน์]. แหล่งที่มา :
<http://www.sec.or.th/index>. 13 เมษายน 2546.
- แบบรายงาน 56-1 : บริษัทเงินทุนทีเอสโก้ จำกัด (มหาชน).** [ออนไลน์]. แหล่งที่มา :
<http://www.sec.or.th/index>. 13 เมษายน 2546.
- พยขน์ หาญพุดงกิจ. **อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.**
วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2532.
- พรชัย จิรวินิจนันท์. **การประยุกต์ใช้ทฤษฎี CAPM กับหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** ภาคนิพนธ์คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์, 2535.
- พรรณี อิศรพงศ์ไพศาล. **การเลือกลงทุนซื้อหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.**
วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2520.
- พัชรภรณ์ คงเจริญ. **หน่วยลงทุนในประเทศไทย อัตราผลตอบแทน ความเสี่ยง และกลยุทธ์ในการลงทุน.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2535.

- พิบูล แซ่โล้ว. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มจีนส่วนอิเล็กทรอนิกส์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- เพชร ชุมทรัพย์. **หลักการลงทุน**. พิมพ์ครั้งที่ 12. กรุงเทพฯ: มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2544.
- ยุทธนา เรือนสุภา. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2542.
- เยาวลักษณ์ อรุณเมศรี. **การลงทุนในหลักทรัพย์ของชาวต่างประเทศในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตร์มหาบัณฑิต สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์, 2534.
- สุธีรา ตั้งตระกูล. **ความสามารถในการพยากรณ์ของการวิเคราะห์ทางเทคนิค และทางเศรษฐศาสตร์ของการเคลื่อนไหวของราคาหุ้น กลุ่มธนาคาร และเงินทุน และหลักทรัพย์**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- สุโลจน์ ศรีแก้ว. **ปัจจัยที่มีความสำคัญต่อดัชนีหุ้นในตลาดหุ้น**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2535.
- หทัยรัตน์ บุญโถ. **การประมาณค่าเบต้าในแบบจำลองการกำหนดราคาสินทรัพย์ประเภททุน**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2541.
- Dickey, D. and Fuller, W.A. "Distribution of the Estimators for Auto Regressive Time Series with a unit root" **Journal of American Statistics Association**. 74(1979): 427 – 431.
- Enders, W. **Applied Econometric Time Series**. New York: John Wiley & Sons, 1995.
- Engle, Robert E. and Granger, Clive W.S. "Cointegration and Error-Correction: Representation, Estimation, and Testing." **Econometrica** 55 (March 1995) : 251-276.
- Fischer, Donald E. and Jordan, Ronald J. **Securities Analysis and Portfolio Management**. New York: McGraw-Hill, 1995.
- Fischer, Donald.E and Jordan, Ronald J. **Security Analysis and Portfolio Management**. Englewood Cliffs, NJ: W Richard D. Irwin, 1995.
- Granger, Clive and Newbold, P. "Spurious Regression in Econometrics." **Journal of Econometrics** 2 (1974): 111 – 120.
- Johansen, Soren. "Statistical Analysis of Cointegration Vectors." **Journal of Economic Dynamics and Control** 12 (June - Sept. 1988): 231 – 254.

- Keran, M.W. "Expectation, Money and the Stock Market." **Federal Reserve Bank of St. Louis Review** 53 (January 1971) : 16-31.
- MacKinnon, J. G. "Critical Values for Cointegration Tests." In **Long-run Economic Relationships: Readings in Cointegration**, pp. 267-276. Edited by Robert E. Engle and Clive W.J. Granger Oxford: University Press, 1991.
- Maddala, G. S. and In Moo Kim. **Unit Roots Cointegration and Structural Change**. New York: Cambridge University Press, 1998.
- Pindyck, Robert S. and Rubinfeld, Daniel L. **Econometric Models and Economic Forecasts**. Singapore: McGraw – Hill, 1998.
- Reuters. **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.

.....