

บรรณานุกรม

- จิรัตน์ สังข์แก้ว. การลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 4. กรุงเทพฯ: มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2544.
- ชวินทร์ ถีนานบรรจง. ประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวมในประเทศไทย 2535-2538. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2539.
- ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์กุล. แบบจำลองเศรษฐกิจสำหรับภาครัฐบาลของประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- ชัยโย กรกิจสุวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนในหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- เดชวิทย์ นิลวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจ มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. “พฤติกรรมการส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 3(กันยายน- ธันวาคม 2542): 16-51.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2546. อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงธนาคารพาณิชย์. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.bot.or.th>. 26 กุมภาพันธ์ 2546.
- น้ำฝน เสนางคนิกร. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- พยชน์ หาญพุดกิจ. อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2532.
- พรชัย จิรวินิจนันท์. การประยุกต์ใช้ทฤษฎี CAPM กับหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. ภาคนิพนธ์คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์, 2535.
- พรรณี อิศรพงศ์ไพศาล. การเลือกลงทุนซื้อหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2520.

- พัชรภรณ์ คงเจริญ. “หน่วยลงทุนในประเทศไทย” อัตราผลตอบแทน ความเสี่ยงและกลยุทธ์ในการลงทุน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2535.
- พิภูม แซ่โล้ว. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มจีนส่วนอิเล็กทรอนิกส์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- พิเชษฐ พรหมสุข. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อค่าพรีเมียมและค่าชดเชยความเสี่ยงในการซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- เพชร ชุมทรัพย์. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 12. กรุงเทพฯ: มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2544.
- เขวาลักษณ์ อรุณมีศรี. การลงทุนในหลักทรัพย์ของชาวต่างประเทศในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์, 2534.
- ยุทธนา เรือนสุภา. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2542.
- รังสรรค์ หทัยเสรี. “Cointegration and Error Correction Approach ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ธรรมศาสตร์ 3(กันยายน 2538): 20-39.
- วิโชติ ตั้งศักดิ์พร. การปรับตัวของอัตราดอกเบี้ยระยะสั้นในประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2540.
- สุโลจน์ ศรีแก้ว. ปัจจัยที่มีความสำคัญต่อดัชนีหุ้นในตลาดหุ้น. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2535.
- สำนักคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์. แบบแสดงรายการข้อมูลประจำปี(56-1). [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.bot.or.th>. 26 กุมภาพันธ์ 2546.
- Clardia, Richard H. and Taylor, Mark P. “The Term Structure of Forward Exchange Premiums and the Forecastability of Spot Exchange Rates : Correcting the Errors.” *The Review of Economics and statistic* (August 1997): 353-361.

- Charemza, W.W. and Deadman, D.F. **New Directions in Econometric Practice: General to Specific Modeling, Cointegration and Vector Autoregression**. 2nd ed. Cheltenham: Edward Elgar, 1997.
- Enders, Walter. **Applied Econometric Time Series**. New York : John Wiley & Sons, 1995.
- Fisher, Donald E. and Jordan, Ronald J. **Security Analysis and Portfolio Management**. 6th ed. Englewood Cliffs: Prentice – Hall, 1995.
- Harris, R.I.D. **Using Cointegration Analysis in Econometric Modelling**. London : Prentice – Hall, 1995.
- Hataiseree, R. “Vector Autoregression, Unit Roots, Cointegration and Error – Correction Mechanism: A General Overview.” **Chulalongkorn Journal of Economics** 8 (May 1996) : 263 – 294.
- Hoffman, D.L. and Rasche, R.H. **STLS/US-VECM 6.1 : A Vector Error - Correction Forecasting Model of the U.S. Economy : Working Paper 97 – 008 A**. St. Louis: Federal Reserve Bank of St. Louis, 1997.
- 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): 169-209.
- Lintner, John. “The Valuation of Risk Assets and the Selection of Risky Investments in Stock Portfolios and Capital Budgets.” **Review of Economics and Statistics** 47,1(February 1965): 13-37.
- Maddala, G.S. and In-Moo Kim. 1998. **Unit Roots Cointegration and Structural Change**. New York: Cambridge University Press, 1998.
- Markowitz, Harry. “Portfolio Selection.” **Journal of Finance** 7(March 1952): 77-91.
- Mossin, Jan. “Equilibrium in a Capital Asset Market.” **Econometrica** 4(October 1966): 768-783.
- Pindyck, Robert S. and Rubinfeld, Deniel 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. 26 February 2003.

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

Wolters, J. "Cointegration and German Bond Yield." **Applied Economics Letter** 5 (1998): 497 – 502.

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Chiang Mai University