

เอกสารอ้างอิง

- กนกกาญจน์ ทวีอภิรดีเจริญ. 2541. ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อราคาหุ้นหมวดอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- กรรณิการ์ ไชยลังกา. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ขนาดกลางในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ขวัญหล้า จันทะพันธ์. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิรวรรณ กิจชัยเจริญ. 2540. การกำหนดราคาเสนอขายหุ้นสามัญใหม่ต่อสาธารณชนในตลาดแลกเปลี่ยนและพฤติกรรมราคาของหุ้นสามัญใหม่ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2540. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- จิราวัลย์ ภูแสงสัน. 2543. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ชวินร์ ลีลาบรรจง. ประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวมในประเทศไทย 2535 - 2538. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ชัยโย กรกิจสุวรรณ. 2540. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เดชวิทย์ นิลวรรณ. 2539. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2542. รู้จักกับตลาดหลักทรัพย์. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2546. รู้จักกับตลาดหลักทรัพย์. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงษ์. 2542. “พฤติกรรมการณ์ส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดระหว่างตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้จัดสรรเงินในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 3(กันยายน - ธันวาคม): 16-51.

ทรงศิริ แต่สมบัติ. 2541. การวิเคราะห์การถดถอย. พิมพ์ครั้งที่ 2. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์.

ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2546. อัตราดอกเบี้ยพันธบัตรรัฐบาล. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: http://www.bot.or.th/bothomepage/databank/FinMarkets/Bond/Bid_Yield03.xls. 15 พฤษภาคม 2546.

ชัชชัย งามสันติวงศ์. 2543. SPSS FOR WINDOWS หลักการและวิธีใช้คอมพิวเตอร์ในงานสถิติเพื่อการวิจัย. พิมพ์ปรับปรุงครั้งที่ 4. กรุงเทพฯ: ซีเอ็ดดูเคชั่น.

นารุณยาน เปี่ยม. 2538. หลักการลงทุน. กรุงเทพฯ: พี.เอ็น.การพิมพ์.

บุญชัย เกียรติธนาวิทย์. 2534. ปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีอิทธิพลต่อราคาหุ้นกลุ่มธนาคารพาณิชย์และบริษัทเงินทุนและหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

บุญศรี ศรีหิรัญกุล. 2539. ปัจจัยที่มีผลกระทบต่ออัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

บุญยัญฉิศจีร์ ชมพูคำ. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์บริษัทผลิตไฟฟ้าบางหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีไดอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

บริษัทหลักทรัพย์ กิมเอ็ง (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน). 2546. บทวิเคราะห์. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา:

http://www.kimeng.co.th/research_info/company_focus/entertain. 30 เมษายน 2546.

ปวีณา คำพุกกะ. 2545. การวิเคราะห์ดัชนีหุ้นไทยโดยวิธีการถดถอยแบบสวิตซิง. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

พยชน์ หาญผดุงกิจ. 2532. อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

- พรชัย จิรวินิจนันท์. 2535. การประยุกต์ใช้ทฤษฎีCAPMกับหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. ภาคนิพนธ์คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์.
- พรรณิ อิศรพงศ์ไพศาล. 2520. การเลือกลงทุนซื้อหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- พัชรภรณ์ คงเจริญ. 2535. การประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวมทั้งหมดในประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- พิกุล แซ่โล้ว. 2544. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มขึ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- พิเชษฐ พรหมศูย์. 2540. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อค่าพรีเมียมและค่าชดเชยความเสี่ยงในการซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เพชร ชุมทรัพย์. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 9. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2538.
- ยุทธนา เรือนสุภา. 2543. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ใน ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เยาวลักษณ์ อรุณมีศรี. 2534. การลงทุนในหลักทรัพย์ของชาวต่างประเทศในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชาเศรษฐศาสตร มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์.
- รังสรรค์ หทัยเสรี. "Cointegration and Error Correction Approach: ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของประเทศไทย." วารสารเศรษฐศาสตรธรรมศาสตร์ 13 (กันยายน): 20-55.
- รุ่งระวี สิทธิกร. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ขนส่งในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชันของโจเซนเซน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ลลิตาพรรณ โพธิโกสุม. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นบางหุ้นในกลุ่มบันเทิงและต้นทนาการโดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

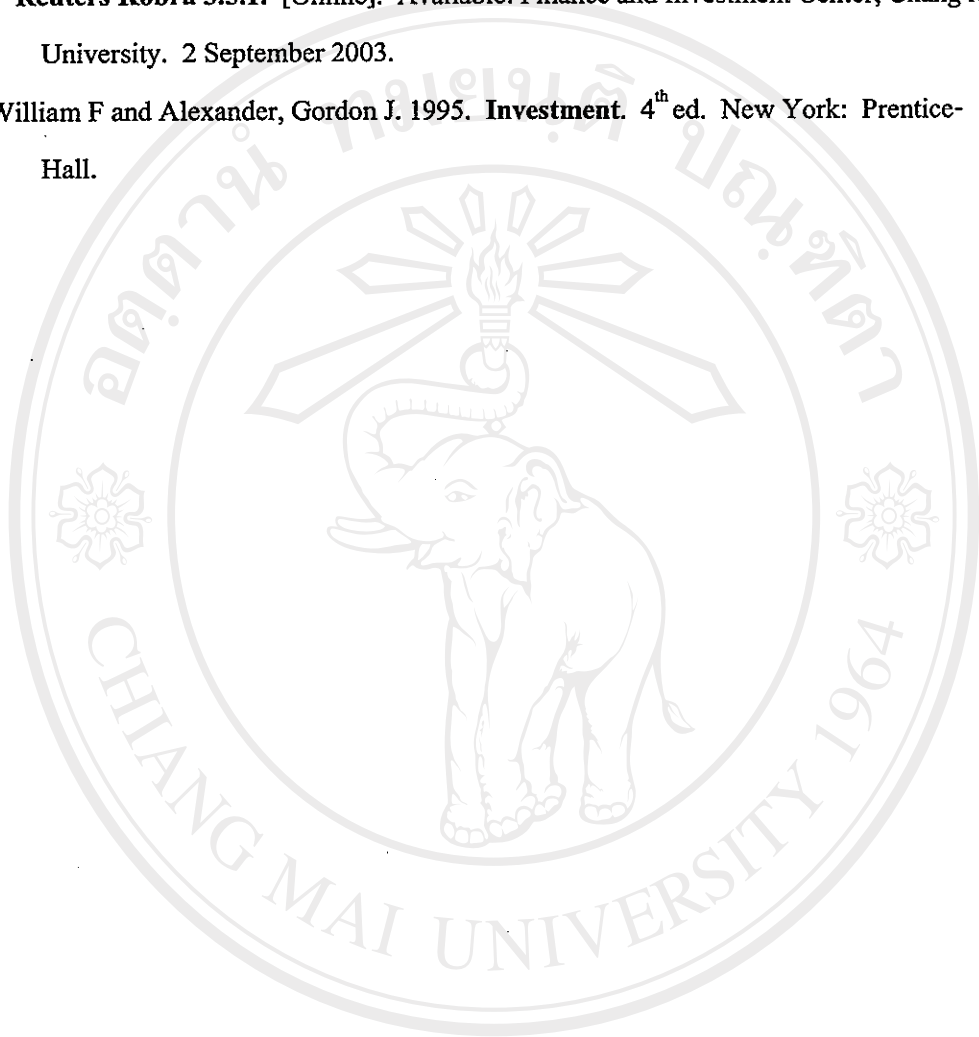
- วิวัฒน์ สุวรรณทา. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นบริษัทเงินทุนบางหุ้นในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีการโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สุโลจน์ ศรีแก้ว. 2535. การวิเคราะห์หุ้นกลุ่มธนาคารและกลุ่มทุนหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สุนทรา สุกันธา. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของธุรกิจเกษตรในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีการโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- หทัยรัตน์ บุญโญ. 2541. การประมาณค่าเบต้าในแบบจำลองการกำหนดราคาสินทรัพย์ประเภทหุ้น. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ศาสตรา ขอสองรัตน์. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์พาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้วิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Dicky, 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.
- Ender, Walter. 1995. *Applied Econometric Time Series*. New York: John Wiley & Sons.
- Engle, Robert E. and Granger, Clive W.J.. "Cointegration and Error-Correction: Representation, Estimation, and Testing." *Econometrica* 55 (March 1987): 251-276.
- Fischer, Donald E. and Jordan, Ronald J. 1995. *Securities Analysis and Portfolio Management*. New York: Prentice-Hall.
- Gujarati, Damodar N. 1995. *Basics Econometrics*. 3rd ed. New York: McGraw-Hill.
- Hataiseree, R "Vector Autoregression, Unit roots, Cointegration and Error- Correction Mechanism: A General Overview." *Chulalongkorn Journal of Economics* 8 (May 1996): 263-294.
- Lintner, J. "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.
- Makowitz, H. "Portfolio Selection." *Journal of Finance* 7 (March 1952): 77-91.
- Mossin, J. "Equilibrium in a Capital Asset Market." *Econometrica* 34, 4 (October 1966): 768-784.

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, Chang Mai University. 2 September 2003.

Sharp, William F and Alexander, Gordon J. 1995. **Investment.** 4th ed. New York: Prentice-Hall.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved