

เอกสารอ้างอิง

- กรรณิการ์ ไชยลังกา. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ธนาคารพาณิชย์ขนาดกลางในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- กวิณ มากณะรุ่ง. **การวิเคราะห์ประสิทธิภาพของเครื่องมือการวิเคราะห์ทางเทคนิคสำหรับการคาดคะเนราคาหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- ขวัญหล้า จันทะพันธ์. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. **การลงทุน.** กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2540.
- ชวินทร์ ลีนาบรจ. **ประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวมในประเทศไทย 2535-2538.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2539.
- ชัยโย กรกิจสุวรรณ. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- เดชวิทย์ นิลวรรณ. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ทมาภรณ์ กองแก้ว. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. "ความสัมพันธ์ระหว่างประสิทธิภาพทางเทคนิค (Technical Efficiency) กับคุณภาพของปัจจัยการผลิต." **วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่** 6, 2 (พฤษภาคม – สิงหาคม 2545): 74-81.

- ธัช อ่าวสมบัติกุล. **ผลกระทบจากการเจริญเติบโตทางด้านปัจจัยการผลิตการเปลี่ยนแปลงทางด้านเทคโนโลยีการผลิตและการปรับปรุงประสิทธิภาพการผลิตที่มีต่อการผลิตทางการเกษตรในภาคกลางของประเทศไทย ระหว่างปี พ.ศ. 2520 ถึง พ.ศ. 2542.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2545.
- น้ำฝน เสนางคนิกร. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- นินนาท เจริญเลิศ. **ปัจจัยกำหนดการลงทุนในหลักทรัพย์และแนวทางการพัฒนาตลาดหลักทรัพย์ในอนาคต.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2532.
- ประพนธ์ เฉลิมพิชัย. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- ประพัทธ์ รัตนวิบูลย์สม. **ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อดัชนีหุ้นในกลุ่มก่อสร้างและวัสดุก่อสร้างในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- พรชัย จิรวินิจนันท์. **การประยุกต์ใช้ทฤษฎี CAPM กับหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** ภาคนิพนธ์ คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์, 2535.
- พรรณี อิศระพงษ์ไพศาล. **การเลือกลงทุนซื้อหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2520.
- พัชราภรณ์ คงเจริญ. **หน่วยลงทุนในประเทศไทย อัตราผลตอบแทน ความเสี่ยง และกลยุทธ์การลงทุน.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2535.
- พัชรี เหลืองรุ่งโรจน์. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นในกลุ่มสื่อสาร โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- พิกุล แซ่โล้ว. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.

เพชร ชุมทรัพย์. **หลักการลงทุน**. พิมพ์ครั้งที่ 10. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2539.

ภูวดล รัชตศรีประเสริฐ. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นขึ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

ยุพธนา เรือนสุภา. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2543.

รุ่งระวี สิทธิกร. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ขนส่งในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชันของโจแฮนเซน**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

วชิรภูมิ เบญจวัฒน์วงศ์. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

วัชรวิ พฤชิกานนท์. **สถิติเศรษฐศาสตร์**. เชียงใหม่: ภาควิชาเศรษฐศาสตร์ คณะสังคมศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2528.

วิทวัส สุวรรณทา. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นบริษัทเงินทุนบางหุ้นในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

วิสุมิตรา วงศ์เลี้ยงถาวร. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชันและเอเรอร์คอร์เรคชัน**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

ศาสตรา ขอบแสงรัตน์. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์พาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้วิธีโคอินทิเกรชัน**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

สุธีรา ตั้งตระกูล. **ความสามารถในการพยากรณ์ของการวิเคราะห์ทางเทคนิคและทางเศรษฐศาสตร์ของการเคลื่อนไหวของราคาหุ้นกลุ่มธนาคารและเงินทุนและหลักทรัพย์**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

สุธีรา เอื้ออุ้มภร. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นบริษัทเงินทุนบางหุ้น โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัย เชียงใหม่, 2546.

สุทิมาพรรณ พู่เจริญ. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุก่อสร้างและตกแต่ง โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัย เชียงใหม่, 2546.

สุโลจณี ศรีแก้ว. **ปัจจัยที่มีความสัมพันธ์ต่อดัชนีราคาหุ้นในตลาดหุ้น**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัย เชียงใหม่, 2535.

หทัยรัตน์ บุญญ. **การประมาณค่าเบต้าในแบบจำลองการกำหนดราคาสินทรัพย์ประเภทหุ้น**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัย เชียงใหม่, 2541.

อนุพัฒน์ สิทธิโชคชัยวุฒิ. **การวิเคราะห์การลงทุนของหุ้นบางหุ้นในกลุ่มเครื่องใช้ไฟฟ้า และคอมพิวเตอร์ โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัย เชียงใหม่, 2546.

Aigner D. J., Lovell, C. A. K. and Schmidt, P. "Formulation and Estimation of Stochastic Frontier Production Function Models." **Journal of Econometrics** 6(July 1977): 21-37.

Battese, George E. **Stochastic Frontier: Concept, Models and Applications**. [N.P.: n.p., 2003]. (Invited Lectures to School of Economics, Chiang Mai University, Thailand October 2003)

Färe, R., Grosskopf, S. and Lovell, C.A.K. **The Measurement of Efficiency of Production** Boston: Kluwer-Nijhoff, 1985.

Färe, R. **Production Frontiers**. New York: Cambridge University Press, 1994.

Fisher, Donald E. and Jordan, Ronald J. **Security Analysis and Portfolio Management**. 6th ed. Englewood Cliffs: Prentice-Hall, 1995.

Johnston, J. and Dinardo, J. **Econometric Methods**. 4th ed. New York: McGraw-Hill, 1997.

Jondrow J. et al. "On the Estimation of Technical Inefficiency in the Stochastic Frontier Production Function Model." **Journal of Econometrics** 19(August 1982): 233-238.

- Lintner, J. "The Valuation of Risk Asset and the Selection of Risky Investments in Stock Portfolios and Capital Budget." **Review of Economics and Statistics** 47, 1 (February 1965): 13-37.
- Maddala, G. S. **Limited Dependent and Qualitative Variables in Econometrics**. New York: Cambridge University Press, 1983.
- Markowitz, Harry. "Portfolio Selection." **Journal of Finance** 7(March 1952): 77-91.
- Meeusen, W. and Van den Broeck, J. "Efficiency Estimation from Cobb–Douglas Production Functions with Composed Error." **International Economic Review** 18, 2(June 1977): 435–444.
- Mossin, Jan. "Equilibrium in a Capital Asset Market." **Econometrica** 34, 4(October 1966): 768-784.
- Reuters. 2003. **Reuters Kobra 3.5.1**. [Online]. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 26 December 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.