

## เอกสารอ้างอิง

- กรรณิการ์ ไชยลังกา. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ขนาดกลางในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิรัตน์ สัมภ์แก้ว. 2540. การลงทุน. กรุงเทพฯ: มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ชัยโย กรกิจสุวรรณ. 2540. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและ ผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เดชวิทย์ นิลวรรณ. 2539. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและ ผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2548. เครื่องมือเพื่อการวิเคราะห์การลงทุน. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตี:ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. “พฤติกรรม การส่งผ่านราคา กุ้งกุลาดำระหว่างตลาดค้าส่งโตเกียวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 3(กันยายน – ธันวาคม): 16-51 อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตี:ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- บุญญณีศวรรค์ ชมพุกำ. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์บริษัทผลิตไฟฟ้าบางหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- พรชัย จิรวินิจนันท์. 2535. การประยุกต์ใช้ทฤษฎี (CAPM)กับหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. กรุงเทพฯ: สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์.

- พิบูล แซ่โล้ว. 2544. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มขึ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ยุทธนา เรือนสุภา. 2543. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วันรักษ์ มิ่งมณีนาคิน. 2543. หลักเศรษฐศาสตร์มหภาค. กรุงเทพฯ: ไทยวัฒนาพานิช.
- ศาสตรา ขอสว่างรัตน์. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์พาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้วิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สวราชย์ ชีรการณวงศ์. 2549. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการลงทุนและการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สุนิสา คำแก้ว. 2549. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างเงินเฟ้อของประเทศไทยกับอัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจ. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อนเนก อุปรา. 2547. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มบันเทิง และ สันทนการโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Fischer, Donald E. and Jordan, Ronald J. 1995. **Securities analysis and portfolio management.** New York: Prentice-Hall.
- Gujarati, Damodar N. 1995. **Basics econometrics.** 3<sup>rd</sup> ed. New York: McGraw-Hill.
- Hu, Jin-Li and Lin, Cheng-Hsun. 2007. **Disaggregated energy consumption and GDP in Taiwan: A threshold cointegration analysis.** Energy Economics, Institute of Business & Management, National Chiao Tung University, Taiwan.
- Lintner, J. 1965. "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): 13-37.

Makawitz, H. 1952. "Portfolio selection." **Journal of Finance** 7 (March): 77-91.

Mossin, J. 1966. "Equilibrium in a capital asset market." **Econometrica** 34, 4(October): 768-784.

Realtime Portal. 2551. กราฟแสดงมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กลุ่มบรจกัณฑ์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. แหล่งที่มา: [http://www.efinancethai.com/rtquote/portal\\_2000/frame\\_portal.asp](http://www.efinancethai.com/rtquote/portal_2000/frame_portal.asp) (2 พฤษภาคม 2551)



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
Copyright© by Chiang Mai University  
All rights reserved