

## เอกสารอ้างอิง

- दनัย ไชยสาร. 2551. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมและดัชนีตลาดหลักทรัพย์โดยวิธีโคอินทิเกรชัน . การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิตมหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ธนัยวงศ์ กীরตวานิชย์. 2547. วิเคราะห์เจาะเรื่องกองทุนรวม. กรุงเทพฯ : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- พิเชษฐ โพธิจรรยากุล. 2547. ศึกษาความเสี่ยงและผลตอบแทนของกองทุนรวมในประเทศ . การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ภวิษฐ์พร วงศ์ศักดิ์ . 2549. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของกองทุนรวมที่ลงทุนในต่างประเทศ. การค้นคว้าอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วรรณญา นวมะรัตน์ . 2550. การวิเคราะห์อัตราผลตอบแทน ความเสี่ยง และความสามารถในการบริหารหลักทรัพย์ของกองทุนรวม .การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัย เชียงใหม่.
- สถาบันพัฒนาความรู้ตลาดทุน .2549. การบริหารกลุ่มสินทรัพย์ลงทุน ทฤษฎีตลาดทุน . ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย พิมพ์ครั้งที่ 2.
- สุรีย์ วังไพบูลย์. 2552. การวิเคราะห์อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงของการลงทุนในกองทุนรวมหุ้นระยะยาว. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- หลักสูตรปริญญาตรีสำหรับผู้ขายหลักทรัพย์ ( Single License ). 2552. ตลาดการเงินและการลงทุนในหลักทรัพย์. ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย พิมพ์ครั้งที่ 9 ฉบับปรับปรุง.
- Box, Jenkin, and Reinsel , G. 1994. **Time Series Analysis**. Englewood Cliffs, NJ : Prentice – Hall.
- Dickey, D., & Fuller, W.A. 1979. “**Distribution of the Estimators for Autoregressive Time Series with a Unit Root.**” Journal of American Statistics Association 74 : 427 – 431
- MacKinnon, J.G. 1991. “Critical Values for Cointegration Test.” **In Long Run Economic Relationships Reading in Cointegration**, pp.267 – 276. Edited by Engle, Robert E. and Grenger, Clive W.J. Oxford : University Press.
- Maddala, G.S. and In Moo Kim. 1998. **Unit Roots Cointegration and Structural Change**. New York : Cambridge University Press

- Markowitz, Harry. 1952. "Portfolio Selection." **Journal of Finance** 7 (March) : 77 – 91
- Mossin, Jan. 1966. "Equilibrium in Capital Asset Market." **Econometrica**, 34, 4 (October) : 768  
- 784
- Pindyck, Robert S. and Rubinfeld, Daniel L. 1998. **Econometrics Models and Economic Forecasts**. Singapore : McGraw – Hill
- Rahman Matiur, and Mustafa Mahamad, 1997. "Dynamics of Real Exports and Real Economic Growths in 13 Selected Countries." **Journal of Economic Development** 22 No.2
- Samuel Cameron. 2005. Formulating a time – series econometrics model : Engle – Granger two – step Model. **Econometrics**. McGraw – Hill : 376 - 378
- Sharpe, William F. 1964. "Capital Asset Prices : A Theory of Market Equilibrium Under Condition of Risk." **Journal of Finance** 19, 3 (September) : 425 – 442