

บรรณานุกรม

- กัญสุดา ลิ้มพิพัฒน์ชัย. แบบจำลองเชิงเศรษฐมิติสำหรับภาคการผลิต ตลาดแรงงานและระดับราคา
ของประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2543.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2540.
- ชวินทร์ ลีนาบรรจง. ประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวมในประเทศไทย 2535 – 2538. วิทยา
นิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2539.
- ชัยโย กรกิจสุวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาด
หลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่,
2540.
- เดชวิทย์ นิลวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสาร ใน
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. “พฤติกรรมการบริโภคกุ้งสดแช่แข็งของตลาดสหรัฐอเมริกา
และญี่ปุ่น.” วารสารเศรษฐศาสตรมหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 4,1(2543): 79-93
- นภเกศน์ เขี่ยมเพชรพงศ์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนและการเลือกลงทุนในหลัก
ทรัพย์กลุ่มสื่อสารโดยใช้แบบจำลอง CAPM: แบบฝึกหัดการวิจัย วิชา 751409. เชียงใหม่:
คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- น้ำฝน เสนางคณิก. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่ง
ประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- แบบรายงาน 56-1: บริษัทแลนด์ แอนด์ เฮ้าส์ จำกัด (มหาชน). [ออนไลน์]. แหล่งที่มา:
<http://www.sec.or.th/index>. 13 เมษายน 2546.
- แบบรายงาน 56-1: บริษัททวอลิตี้ จำกัด (มหาชน). [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.sec.or.th/index>.
13 เมษายน 2546.
- แบบรายงาน 56-1: บริษัทสุภาลัย จำกัด (มหาชน). [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.sec.or.th/index>.
13 เมษายน 2546.

แบบรายงาน 56-1: บริษัทอิตาเลียนไทย ดีเวลลอปเมนต์ จำกัด (มหาชน). [ออนไลน์]. แหล่งที่มา:

<http://www.sec.or.th/index>. 13 เมษายน 2546.

พิกุล แซ่โล้ว. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มขึ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.

พิเชษฐ์ พรหมผุย. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อค่าพรีเมียมและค่าชดเชยความเสี่ยงในการซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540

เพชร ชุมทรัพย์. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 10. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2539.
ยุทธนา เรือนสุภา. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2543.

สุโลจน์ ศรีแก้ว. การวิเคราะห์หุ้นกลุ่มธนาคารและกลุ่มทุนหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2535.

Charemza, Wojciech W. and Deadman, Derek F. **New Directions in Econometric Practice: General to Specific Modeling, Cointegration and Vector Autoregression**. Aldershot: Edward Elgar, 1992.

Dickey, D. and Fuller, W.A. "Distribution of the Estimators for Auto Regressive Time Series with a unit root." **Journal of American Statistics Association**. 74 (1979): 427-431.

Enders, W. **Applied Econometric Time Series**. New York: John Wiley & Sons, 1995.

Fischer, Donald E. and Jordan, Ronald J. **Securities Analysis and Portfolio Management**.

Englewood Cliff, NJ: W Richard D. Irwin, 1995.

Granger, Clive and Newbold, P. "Spurious Regression in Econometrics." **Journal of Econometrics** 2 (1974): 111-120.

Gujarati, Damodar N. **Basics Econometrics**. 3rd ed. New York: McGraw – Hill, 1995.

Johnston, J. and Dinardo, J. **Econometric Methods**. New York: McGraw – Hill, 1997.

MacKinnon, J. G. "Critical Values for Cointegration Tests." In **Long-run Economic Relationships:**

Readings in Cointegration. Edited by Robert F. Engle and Clive W.J. Granger. Oxford:

Oxford University Press, 1991. pp.267-276

Maddala, G. S. and In Moo Kim. **Unit roots Cointegration and Structural Change**. New York: Cambridge University Press, 1991.

Pindyck, Robert S. and Rubinfeld, Daniel L. **Econometric Models and Economic Forecasts**. Boston, MA: Irwin/McGraw – Hill, 1998.

Reuter. **Reuters Kobra 3.5.1**. [Online]. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 22 January 2003.

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