

บรรณานุกรม

- จิรัตน์ สัจจ์แก้ว. 2540. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- จิราวัลย์ ภูแสงสั้น. 2543. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มเงินทุนหลัก
ทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
 มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ชัยโย กรกิจสุวรรณ. 2540. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลัง
งานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
 มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เดชวิทย์ นิลวรรณ. 2539. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารใน
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต
 มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2546. **ดัชนีมูลค่าการซื้อขายสูงสุดของกลุ่มอุตสาหกรรม.**
 [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th>. 24 พฤษภาคม 2546.
- ธวัชชัย งามสันติวงศ์. 2543. **SPSS FOR WINDOWS หลักการและวิธีใช้คอมพิวเตอร์ในงานสถิติเพื่อ
 การวิจัย.** พิมพ์ปรับปรุงครั้งที่ 4. กรุงเทพฯ: ซีเอ็ดดูเคชั่น.
- พยชน์ หาญผดุงกิจ. 2532. **อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.**
 วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- พรชัย จิรวินิจนนท์. 2535. **การประยุกต์ใช้ทฤษฎีCAPMกับหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ในตลาด
 หลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** กรุงเทพฯ: ภาคนิพนธ์คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิต
 พัฒนบริหารศาสตร์.
- พรรณี อิศรพงศ์ไพศาล. 2520. **การเลือกลงทุนซื้อหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.**
 วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

- พิบูล แซ่โล้ว. 2544. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มจีนส่วนอิเล็กทรอนิกส์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เพชร ชุมทรัพย์. 2538. **หลักการลงทุน.** พิมพ์ครั้งที่ 9. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ยุทธนา เรือนสุภา. 2543. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เยาวลักษณ์ อรุณมีศรี. 2534. **การลงทุนในหลักทรัพย์ของชาวต่างประเทศในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์.
- หทัยรัตน์ บุญโญ. 2541. **การประมาณค่าเบต้าในแบบจำลองการกำหนดราคาสินทรัพย์ประเภททุน.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Ender, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series.** New York: John Wiley & Sons.
- Engle, Robert E. and Granger, Clive W.J. 1987. "Cointegration and Error-Correction : Representation, Estimation, and Testing." **Econometrica** 55 (March): 251-276.
- Fischer, Donald E. and Jordan, Ronald J. 1995. **Security Analysis and Portfolio Management.** New York: Prentice-Hall.
- Johansen, Soren and Juselius, Katerina. 1990. "Maximum Likelihood Estimation and Inference on Cointegration with Application to the Demand for money." **Oxford Bulletin of Economics and Statistics** 52: 169-209.
- Reuters. 2003. **Reuters Kobra 3.5.1.** [Online]. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 8 May 2003.
- Sharp, William F and Alexander, Gordon J. 1995. **Investment.** 4th ed. New York: Prentice-Hall.