บรรณานุกรม

จิรัตน์ สังข์แก้ว. **การลงทุน.** กรุงเทพฯ:โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2540.

ชัยโย กรกิจสุวรรณ. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. "พฤติกรรมการส่งผ่านราคากุ้งกุลาดำระหว่างตลาดค้าส่งโตเกียวกับตลาดผู้คัดบรรจุในประเทศไทย." **วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่** 3(กันยายน–ธันวาคม 2542): 16-51.

ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2546. **อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงธนาคารพาณิชย์.** [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: http://www.bot.or.th. 25 กุมภาพันธ์ 2546.

น้ำฝน เสนางคนิกร. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.

พรชัย จิรวินิจนันท์. **การประยุกต์ใช้ทฤษฎี CAPM กับหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** ภาคนิพนธ์มหาบัณฑิต คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์, 2535.

ภคพงษ์ พุมอาภรณ์. **แบบจำลองเศรษฐมิติสำหรับภาคการลงทุนของไทย.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.

ยุทธนา เรือนสุภา. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2543.

สัจจพันธ์ คุรุภากรณ์. **ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์. 2546. **แบบแสดงรายการข้อมูลประจำปี(แบบ56-1).** [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: http://www.sec.or.th/corp_fin/cgi_fin/cgi_bin/result56.php?from_page=find56&lang=t&cmb_cpmp_id=0420. 24 กุมภาพันธ์ 2546

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

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

Engle, Robert E. and Granger, C. J. W. "Cointegration and Error-Correction: Representation, Estimation, and Testing." **Econometrica**, 55 (March 1987): 251-276.

Fischer, D.E and R. Jordan, J. **Securities Analysis and Portfolio Management.** 6th ed. New Jersey: Prentice-Hall, 1995

Gujarati, D. **Basic Econometric.** 3rd ed. New York: McGraw-Hill, 1992.

Johansen, Soren. "Statistical analysis of Cointegration Vectors." **Journal of Economic Dynamics and Control** 12 (June-September. 1988): 231-54.

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

Lintner, J. "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 1965): 13-37.

Maddala, G.S. and In-Muu Kim. **Unit Roots Cointegration and Structural Change.** New York: Cambridge University Press, 1998.

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

Mossin, J. "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. 24 February 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.