

บรรณานุกรม

- จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2543. **การลงทุน**. พิมพ์ครั้งที่ 3. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ชัยโย กรกิจสุวรรณ. 2540. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์**
ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ชวินทร์ ลีนาบรจ. 2539. **ประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวมในประเทศไทย 2535 – 2538**.
วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. “พฤติกรรมกำลงส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดระหว่างตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” **วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่** 3 (กันยายน- ธันวาคม 2542): 16-51
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2546. **อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงธนาคารพาณิชย์**. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.bot.or.th>. 26 กุมภาพันธ์ 2546.
- ธวัชชัย งามสันติวงศ์. 2543. **SPSS FOR WINDOWS หลักการและวิธีใช้คอมพิวเตอร์ในงานสถิติเพื่อการวิจัย**. พิมพ์ปรับปรุงครั้งที่ 4. กรุงเทพฯ: ซีเอ็ดดูเคชั่น.
- พยชน์ หาญผดุงกิจ. 2532. **อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**.
วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- พรชัย จีรวินิจนนท์. 2535. **การประยุกต์ใช้ทฤษฎี CAPM กับหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. ภาคนิพนธ์คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์.
- เพชร ชุมทรัพย์. 2538. **หลักการลงทุน**. พิมพ์ครั้งที่ 9. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ยุทธนา เรือนสุภา. 2543. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เยาวลักษณ์ อรุณมีศรี. 2534. **การลงทุนในหลักทรัพย์ของชาวต่างประเทศในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์.

- รังสรรค์ หทัยเสรี. 2538. "Cointegration and Error Correction Approach ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของไทย." **วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์** 3 (กันยายน 2538): 20-39.
- สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์. **แบบแสดงรายการข้อมูลประจำปี (56-1)**. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.bot.or.th>. 26 กุมภาพันธ์ 2546.
- หทัยรัตน์ บุญโถ. 2541. **การประมาณค่าเบต้าในแบบจำลองการกำหนดราคาสินทรัพย์ประเภทหุ้น**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Charemza, Wojciech W. and Deadman, Derek F. 1992. **New Directions in Econometrics: General to Specific Modeling, Cointegration and Vector Autoregression**. Aldershot: Edward Elgar.
- Clardia, Richard H. and Taylor, Mark P. 1997. "The Term Structure of Forward Exchange Premiums and the Forecastability of Spot Exchange Rates: Correcting the Errors." **The Review of Economics and Statistics** 3 (August): 353-361.
- Enders, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series**. New York: John Wiley & Sons.
- Fischer, Donald E. and Jordan, Ronald J. 1995. **Security Analysis and Portfolio Management**. Englewood Cliffs, NJ: Prentice – Hall.
- Harris, R.I.D. 1957. **Using Cointegration Analysis in Econometric Modelling**. London: Prentice – Hall.
- Johnston, Jack and DiNardo, John. 1997. **Econometric Methods**. New York: McGraw – Hill.
- Maddala, G.S. and In-Moo Kim. 1998. **Unit Roots Cointegration and Structural Change**. New York: Cambridge University Press.
- Pindyck, Robert S. and Rubinfeld, Daniel L. 1998. **Econometric Models and Economic Forecasts**. Boston, MA: McGraw - Hill.
- Reuters. 2003. **Reuters Kobra 3.5.1**. [Online]. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 26 February 2003.
- Sharpe, William F.; Alexander, Gordon J. and Bailey, Jeffery V. 1995. **Investment**. Englewood Cliffs, NJ: Prentice – Hall.
- Wolters, J. 1998. "Cointegration and German Bond Yield." **Applied Economics Letters** 5: 497-502.