บรรณานุกรม

ภาษาไทย

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

ชวินร์ ลีนาบรรจง. **ประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวมในประเทศไทย2535-2538**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2539.

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

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

เดชวิทย์ นิลวรรณ. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.

พัชราภรณ์ คงเจริญ. **หน่วยลงทุนในประเทศไทย อัตราผลตอบแทน ความเสี่ยง และกลยุทธ์การลงทุน**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2535.

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

พรรณี อิสระพงศ์ไพศาล. **การเลือกลงทุนซื้อหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2520.

พิกุล แซ่โล้ว. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.

เพชรี ขุมทรัพย์. **หลักการลงทุน**. พิมพ์ครั้งที่ 10. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2539.

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

วัชรี พฤกษิกานนท์. **สถิติเศรษฐศาสตร์.** เชียงใหม่: ภาควิชาเศรษฐศาสตร์ คณะสังคมศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2528.

สุโลจนี ศรีแก้ว. **ปัจจัยที่มีความสัมพันธ์ต่อดัชนีราคาหุ้นในตลาดหุ้น.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2535.

หทัยรัตน์ บุญโญ. **การประมาณค่าเบต้าในแบบจำลองการกำหนดราคาสินทรัพย์ประเภททุน.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2541.

ภาษาอังกฤษ

Dicky, D and Fuller, W.A. "Distribution of the estimaters for autoregressive time series with a unit root." **American Statistics Association** 74 (1979): 427-431.

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

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

Flscher, Donald E. and Jordan, Ronald J. **Securities Analysis and Portfolio Management.** New York: Prentice-Hall, 1995.

Johansen, Soren and Juselius, Katerina. "Maximum Likelihood Estimation and Inference on Cointegration with Application to the Demand for money." **Oxford Bulletin of Economics and Statistics** 52 (1990): 169-209.

MacKinnon, J.G. "Critical Values for Cointegration Tests." **Long-run Economic Relationships.** Oxford: Oxford University (1991): 267-276.

Reuters. 2002. **Reuters Kobra 3.5.1.** [Online]. Available: Finance and Investment Center, Chaing Mai University. 3 December 2002.

Sharp, William F and Alexander, Gordon J. **Investment.** 4th ed. New York: Prentice-Hall, 1995.