

เอกสารอ้างอิง

- กรรณิการ์ ไชยลังกา. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ธนาคารพาณิชย์ขนาดกลางในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- คัทริยา พานประเสริฐ. 2550. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้แบบจำลอง ฟามาและเฟรนช์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จตุรันต์ พึ่งพุทธรักษ์. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นธนาคารพาณิชย์ขนาดกลาง โดยวิธีการถดถอยแบบสลับสับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ถวิล นิลใบ. 2553. **The Capital Asset Pricing Model: CAPM**. เอกสารประกอบการบรรยายวิชา Financial Management. [ออนไลน์].
แหล่งที่มา: www.eco.ru.ac.th/tawin/financial/Capm.pdf.6 มีนาคม 2553.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์. พิมพ์ครั้งที่ 1. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่. 476-478.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2553. **SET & External Stock Market Indexes**. [ออนไลน์].
แหล่งที่มา: http://www2.bot.or.th/statistics/Download/FM_CM_001_TH.PDF. 6 มีนาคม 2553
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2553. **ดัชนีราคาผู้บริโภค**. [ออนไลน์].
แหล่งที่มา: http://www.indexpr.moc.go.th/price_present/cpi/stat/others/report_core1.asp?tb=cpig_index_country&code=93&c_index=a.change_year. 4 เมษายน 2553.
- ประพนธ์ เกลิมพิชัย. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ โดยวิธีการถดถอยแบบสลับสับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ฝ่ายวางแผนกลยุทธ์องค์กร. 2553. **ภาวะตลาดหลักทรัพย์**. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: www.set.or.th. 10 เมษายน 2553.

มฤณัฏฐ์ คงหัวรอบ. 2550. การวิเคราะห์ความเสี่ยงตามการเปลี่ยนแปลงของเวลาของหลักทรัพย์ในกลุ่มเทคโนโลยีในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ยุทธนา เรือนสุภา. 2543. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

สถาบันพัฒนาบุคลากรธุรกิจหลักทรัพย์ (TSI) ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2553. หลักสูตรความรู้พื้นฐานเกี่ยวกับตลาดเงินและตลาดทุน. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: elearning1.set.or.th/tsi/tsi5004/tsi5.pdf. 10 เมษายน 2553.

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์. 2553. สถิติสำคัญตลาดทุนไทย. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: http://www.sec.or.th/infocenter/report/Content_0000000135.jsp?categoryID=CAT0000122&lang=th. 6 มีนาคม 2553.

อัครพงษ์ อินทอง. 2546. คู่มือการใช้โปรแกรม EViews เพื่อการวิเคราะห์ Unit Root, Cointegration และ Error Correction Model (ตามวิธีการของ Engle and Granger). เชียงใหม่: สถาบันวิจัยสังคม มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

อังกัรามา มหัตติ. 2550. การวิเคราะห์ความเสี่ยงตามการเปลี่ยนแปลงของเวลาของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

Ben McClure. 2553. **The Capital Asset Pricing Model: An Overview**. [online]. แหล่งที่มา: <http://www.investopedia.com/articles/06/CAPM.asp>. 6 March 2010.

Reuters. 2010. **Reuters Kobra 3.5.1**. [online]. Available: Finance Investment Center, Chiangmai University. 7 April 2010.

Zivot and Wang. 2006. **Modeling Financial Time Series with S-Plus**. The United States of America.