

บรรณานุกรม

- จิรัตน์ สังข์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2540.
- จิราวัลย์ ภูแสงสัน. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มเงินทุนหลัก
ทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหา
บัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2543.
- ชัยโย กรกิจสุวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่ม
พลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหา
บัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- เดชวิทย์ นิลวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารใน
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. “พฤติกรรมการบริโภคกุ้งสดแช่แข็งของตลาดสหรัฐ
อเมริกาและญี่ปุ่น.” วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 4,1(2543): 79-93.
- ธวัชชัย งามสันติวงศ์. SPSS FOR WINDOWS หลักการและวิธีใช้คอมพิวเตอร์ในงานสถิติ
เพื่อการวิจัย. พิมพ์ปรับปรุงครั้งที่ 4. กรุงเทพฯ: ซีเอ็ดดูเคชั่น, 2543.
- ธวัชชัย จิตติวิชิตวงศ์. “สภาพแนวโน้มขั้วปมทำนายเศรษฐกิจไทย ทำไมโต 3.5-4.5 %.” มติชน 10
มกราคม 2546: 2.
- แบบรายงาน 56-1 : บริษัทซีเฟรชอินดัสตรี จำกัด (มหาชน). [ออนไลน์]. แหล่งที่มา:
<http://www.sec.or.th/index>. 26 เมษายน 2546.
- แบบรายงาน 56-1 : บริษัทจีเอฟพีที จำกัด (มหาชน). [ออนไลน์]. แหล่งที่มา:
<http://www.sec.or.th/index>. 26 เมษายน 2546.
- แบบรายงาน 56-1 : บริษัทเจริญโภคภัณฑ์อาหาร จำกัด (มหาชน). [ออนไลน์]. แหล่งที่มา:
<http://www.sec.or.th/index>. 26 เมษายน 2546.
- แบบรายงาน 56-1 : บริษัทศรีตรังแอโกรอินดัสตรี จำกัด (มหาชน). [ออนไลน์]. แหล่งที่มา:
<http://www.sec.or.th/index>. 26 เมษายน 2546.
- พยชนี หาญผดุงกิจ. อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2532.

- พรชัย จิรวินิจนันท์. การประยุกต์ใช้ทฤษฎี CAPM กับหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. ภาคนิพนธ์คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์, 2535.
- พรรณี อิศรพงศ์ไพศาล. การเลือกลงทุนซื้อหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2520.
- พิกุล แซ่โล้ว. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มดัชนีส่วนอิเล็กทรอนิกส์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- พิเชษฐ์ พรหมมุข. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อค่าพรีเมียมและค่าชดเชยความเสี่ยงในการซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- เพชร ชุมทรัพย์. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 9. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2538.
- พัชราภรณ์ คงเจริญ. หน่วยลงทุนในประเทศไทย อัตราผลตอบแทน ความเสี่ยง และ กลยุทธ์การลงทุน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2535.
- ยุทธนา เรือนสุภา. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2543.
- เยาวลักษณ์ อรุณมีศรี. การลงทุนในหลักทรัพย์ของชาวต่างประเทศในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์, 2534.
- รังสรรค์ หทัยเสรี. "Cointegration and Error Correction Approach: ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของประเทศไทย." วารสารเศรษฐศาสตร์ธรรมศาสตร์ 13 (กันยายน): 20-55.
- หทัยรัตน์ บุญโญ. การประมาณค่าเบต้าในแบบจำลองการกำหนดราคาสินทรัพย์ประเภททุน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2541.
- Dickey, D., & Fuller, W.A. "Distribution of the Estimators for Autoregressive Time Series with a Unit Root." *Journal of American Statistics Association* 74(1979): 427-431.
- Fischer, Donald E. and Jordan, Ronald J. *Securities Analysis and Portfolio Management*. New York: McGraw-Hill, 1995.

- Enders, W. **Applied Econometric Time Series**. New York: Wiley, 1995.
- Engle, Robert E. and Granger, Clive W.J. "Cointegration and Error – Correction: Representation, and Testing." **Econometrica** 55(March 1987): 251-276.
- Gujarati, D. **Basic Econometrics**. 3rd ed. New York: McGraw–Hill, 1995.
- Hataiseree, R. "Vector Autoregression, Unit Roots, Cointegration and Error – Correction Mechanism: A General Overview." **Chulalongkorn Journal of Economics** 8 (May 1996): 263-294.
- 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), 196-209.
- Johnston, J. and DiNardo, J. **Econometric Methods**. Singapore: McGraw – Hill, 1997.
- MacKinnon, J. G. "Critical Values for Cointegration Tests." In **Long-run Economic Relationships: Readings in Cointegration**, pp. 267-276. Edited by Engle, Robert E. and Granger, Clive W.J. Oxford: University Press, 1991.
- Maddala, G. S. and In Moo Kim. **Unit Roots Cointegration and Structural Change**. New York: Cambridge University Press, 1998.
- Pindyck, Robert S. and Rubinfeld, Deniel L. **Econometric Models and Economic Forecasts**. Singapore: McGraw – Hill, 1998.
- Reuters. **Reuters Kobra 3.5.1**. [Online]. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University 22 January 2003.
- Wolters, J. "Cointegration and German Bond Yield." **Applied Economics Letters** 5 (1998): 497-502.
-