

เอกสารอ้างอิง

- กรรณิการ์ ไชยลังกา. ก ารวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ธนาคารพาณิชย์ขนาดกลางในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- กวิน มากชนะรุ่ง. ก ารวิเคราะห์ประสิทธิภาพของเครื่องมือการวิเคราะห์ทางเทคนิคสำหรับการคาดคะเนราคาหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- ขวัญหล้า จันทะพันธ์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2540.
- ชวินร์ ลีนาบรจจ. ประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวมในประเทศไทย 2535-2538. วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2539.
- ชัยโย กรกิจสุวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- เดชวิทย์ นิลวรรณ. ก ารวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ทมาภรณ์ กองแก้ว. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารีย์ วิบูลย์พงศ์. “ความสัมพันธ์ระหว่างประสิทธิภาพทางเทคนิค (Technical Efficiency) กับคุณภาพของปัจจัยการผลิต, “วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 6, 2 (พฤษภาคม – สิงหาคม 2545): 74-81.

รัช อ่าวสมบัติกุล. ผลกระทบจากการเจริญเติบโตทางด้านปัจจัยการผลิตการเปลี่ยนแปลงทางด้านเทคโนโลยีการผลิตและการปรับปรุงประสิทธิภาพการผลิตที่มีต่อการผลิตทางการเกษตร ในภาคกลางของประเทศไทย ระหว่างปี พ.ศ. 2520 ถึง พ.ศ. 2542. วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2545.

น้ำฝน เสนางคนิกร. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.

นินนาท เจริญเลิศ. ปัจจัยกำหนดการลงทุนในหลักทรัพย์และแนวทางการพัฒนาตลาดหลักทรัพย์ในอนาคต. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2532.

ประพนธ์ เถлимพิชัย. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

ประพัทธ์ รัตนวิบูลย์สม. ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อดัชนีหุ้นในกลุ่มก่อสร้างและวัสดุก่อสร้างในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

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

พรรณี อิสระพงศ์ไพศาล. การเลือกลงทุนซื้อหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2520.

พัชรารภรณ์ คงเจริญ. หน่วยลงทุนในประเทศไทย อัตราผลตอบแทน ความเสี่ยง และกลยุทธ์การลงทุน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2535.

พัชรี เหลืองรุ่งโรจน์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นในกลุ่มสื่อสาร โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

- พิบูล แซ่โล้ว. ก ารวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มหุ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- เพชร ชุมทรัพย์. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 10. กรุงเทพฯ : สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2539.
- ภูวดล รัชตศรีประเสริฐ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- บุษนา เรือนสุภา. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2543.
- รุ่งระวี สิทธิกร. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ขนส่งในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชันของโจแฮนเซน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- วชิรภูมิ เบญจวัฒน์วงศ์. ก ารวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- วัชร พฤทธิกานนท์. ส ติติเศรษฐศาสตร์. เชียงใหม่ : ภาควิชาเศรษฐศาสตร์ คณะสังคมศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2528.
- วิทวัส สุวรรณทา. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นบริษัทเงินทุนบางหุ้นในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- วิศุมิตรา วงศ์เลี้ยงดาว. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชันและเอเรอร์คอร์เรคชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

- ศาสตรา ยอแสงรัตน์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์พาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้วิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- สุธีรา ตั้งตระกูล. ความสามารถในการพยากรณ์ของการวิเคราะห์ทางเทคนิคและทางเศรษฐศาสตร์ของการเคลื่อนไหวของราคาหุ้นกลุ่มธนาคารและเงินทุนและหลักทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- สุธีรา เอื้ออัมภร. ก. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นบริษัทเงินทุนบางหุ้น โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- สุพิมพรรณ พู่เจริญ. ก. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุก่อสร้างและตกแต่ง โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. แบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- สุโลจน์ ศรีแก้ว. ปัจจัยที่มีความสัมพันธ์ต่อดัชนีราคาหุ้นในตลาดหุ้น. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2535.
- หทัยรัตน์ บุญโญ. การประเมินค่าเบี่ยงเบนในแบบจำลองการกำหนดราคาสินทรัพย์ประเภทหุ้น. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2541.
- อนุพัฒน์ สิทธิโชคชัยวุฒิ. การวิเคราะห์การลงทุนของหุ้นบางหุ้นในกลุ่มเครื่องใช้ไฟฟ้า และคอมพิวเตอร์ โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- Aigner D.J., Lovell, C. A. K. and Schmidt, P. "Formulation and Estimation of Stochastic Frontier Production Function Models." *Journal of Econometrics* 6(July 1977) : 21-37.
- Battese, George E. *Stochastic Frontier : Concept, Models and Applications*. [N.P. : n.p., 2003]. (Invited Lectures to School of Economics, Chiang Mai University, Thailand October 2003)
- Fare, R., Grosskopf, S. and Lovell, C.A.K. *The Measurement of Efficiency of Production* Boston : Kluwer-Nijhoff, 1985.

- Fare, R. **Production Frontiers**. New York : Cambridge University Press, 1994.
- Fisher, Donald E. and Jordan, Ronald J. **Security Analysis and Portfolio Management**. 6th ed. Englewood Cliffs : Prentice-Hall, 1995.
- Johnston, J. and Dinardo, J. **Econometric Methods**. 4th ed. New York : McGraw-Hill, 1997.
- Jondrow J. et al. "On the Estimation of Technical Inefficiency in the Stochastic Frontier Production Function Model." **Journal of Econometrics** 19(August 1982) : 233-238.
- Lintner, J. "The Valuation of Risk Asset and the Selection of Risky Investments in Stock Portfolios and Capital Budget." **Review of Economics and Statistics** 47, 1(February 1965) : 13-37.
- Maddala, G. S. **Limited Dependent and Qualitative Variables in Econometrics**. New York : Cambridge University Press, 1983.
- Markowitz, Harry. "Portfolio Selection." **Journal of Finance** 7(March 1952) : 77-91.
- Meeusen, W. and Van den Broeck, J. "Efficiency Estimation from Cobb-Douglas Production Functions with Composed Error." **International Economic Review** 18, 2(June 1977) : 435-444.
- Mossin, Jan. "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. 26 December 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.