

เอกสารอ้างอิง

กรมธุรกิจพลังงาน. กรุงเทพฯ: กรมธุรกิจพลังงาน, 2546. (เอกสารไม่เผยแพร่)

กรมพัฒนาและส่งเสริมพลังงาน. กรุงเทพฯ: กรมพัฒนาและส่งเสริมพลังงาน, 2545. (เอกสารไม่เผยแพร่)

กรรณิการ์ ไชยลังกา. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ธนาคารพาณิชย์ขนาดกลางในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

กวิณ มากชนะรุ่ง. การวิเคราะห์ประสิทธิภาพของเครื่องมือการวิเคราะห์ทางเทคนิคสำหรับการคาดคะเนราคาหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

การประปานครหลวง. กรุงเทพฯ: การประปานครหลวง, 2546. (เอกสารไม่เผยแพร่)

การไฟฟ้าฝ่ายผลิตแห่งประเทศไทย. กรุงเทพฯ: การไฟฟ้าฝ่ายผลิตแห่งประเทศไทย, 2546. (เอกสารไม่เผยแพร่)

ขวัญหล้า จันทะพันธ์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

จิรัตน์ สังข์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2540.

ชวินทร์ ตีนาบรรจง. ประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวมในประเทศไทย 2535-2538.

วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2539.

ชัยโย ภารกิจสุวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.

ณัฐธิดา ชลนาคเกษม. ความสามารถในการพยากรณ์ของการวิเคราะห์ทางเทคนิคบางเทคนิคของราคาหุ้นกลุ่มพลังงาน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547.

- เดชวิทย์ นิลวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ทมาภรณ์ กองแก้ว. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารีย์ วิบูลย์พงศ์. “ความสัมพันธ์ระหว่างประสิทธิภาพทางเทคนิค (Technical Efficiency) กับคุณภาพของปัจจัยการผลิต” วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 6, 2(พฤษภาคม – สิงหาคม 2545): 74-81.
- รัช อ่าวสมบัติกุล. ผลกระทบจากการเจริญเติบโตทางด้านปัจจัยการผลิตการเปลี่ยนแปลงทางด้านเทคโนโลยีการผลิตและการปรับปรุงประสิทธิภาพการผลิตที่มีต่อการผลิตทางการเกษตรในภาคกลางของประเทศไทย ระหว่างปี พ.ศ. 2520 ถึง พ.ศ. 2542. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2545.
- น้ำฝน เสนางคนิกร. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- นินนาท เจริญเลิศ. ปัจจัยกำหนดการลงทุนในหลักทรัพย์และแนวทางการพัฒนาตลาดหลักทรัพย์ในอนาคต. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2532.
- ประพนธ์ เกลิมพิชัย. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- ประพัทธ์ รัตนวิบูลย์สม. ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อดัชนีหุ้นในกลุ่มก่อสร้างและวัสดุก่อสร้างในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- พรชัย จิรวินิจนันท์. การประยุกต์ใช้ทฤษฎี CAPM กับหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. ภาคนิพนธ์ คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์, 2535.
- พรรณี อิศระพงศ์ไพศาล. การเลือกลงทุนซื้อหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2520.
- พัชราภรณ์ คงเจริญ. หน่วยลงทุนในประเทศไทย อัตราผลตอบแทน ความเสี่ยง และกลยุทธ์การลงทุน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2535.

- พัชรีย์ เหลืองรุ่งโรจน์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นในกลุ่มสื่อสาร โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- พิบูล แซ่โล้ว. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- เพชร ชุมทรัพย์. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 10. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2539.
- ภูวดล รัชตศรีประเสริฐ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- บุษยามา เรือนสุภา. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2543.
- รุ่งระวี สิทธิกร. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ขนส่งในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชันของโจแฮนเซน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- วชิรภูมิ เบญจวัฒนวงศ์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- วัชรีย์ พฤทธิกานนท์. สถิติเศรษฐศาสตร์. เชียงใหม่: ภาควิชาเศรษฐศาสตร์ คณะสังคมศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2528.
- วิทวัส สุวรรณทา. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นบริษัทเงินทุนบางหุ้นในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- วิสุมิตรา วงศ์เลี้ยงถาวร. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชันและเอเรอร์คอร์เรคชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

ศาสตรา ยอแสงรัตน์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์พาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้วิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

สุธีรา ตั้งตระกูล. ความสามารถในการพยากรณ์ของการวิเคราะห์ทางเทคนิคและทางเศรษฐศาสตร์ของการเคลื่อนไหวของราคาหุ้นกลุ่มธนาคารและเงินทุนและหลักทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

สุธีรา เอื้ออัมภร. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นบริษัทเงินทุนบางหุ้น โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

สุพิมพรรณ พู่เจริญ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุก่อสร้างและตกแต่ง โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. แบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

สุโลจน์ ศรีแก้ว. ปัจจัยที่มีความสัมพันธ์ต่อดัชนีราคาหุ้นในตลาดหุ้น. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2535.

หทัยรัตน์ บุญใหญ่. การประเมินค่าเบต้าในแบบจำลองการกำหนดราคาสินทรัพย์ประเภทหุ้น. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2541.

อนุพัฒน์ สิทธิโชคชัยวุฒิ. การวิเคราะห์การลงทุนของหุ้นบางหุ้นในกลุ่มเครื่องใช้ไฟฟ้าและคอมพิวเตอร์ 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)

Du Toit, Gabriel Scholtz. *Technical Analysis and Market Efficiency on the Johannesburg Stock Exchange*. Doctoral dissertation. University of South Africa, 1986.[CD-ROM] Abstract from: Sliver Platter. File: Disserttion Abstracts.

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**. 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.