

## เอกสารอ้างอิง

- กมลวรรณ กิติพัฒน์วิทย์. 2548. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณหลักทรัพย์ในกลุ่มขนส่งของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- กระทรวงคมนาคม. 2547. ปริมาณการขนส่งสินค้าภายในประเทศและระหว่างประเทศ. แหล่งที่มา <http://www.mot.go.th> 1 มกราคม 2549
- การวิเคราะห์หลักทรัพย์โดยใช้ปัจจัยพื้นฐาน. 2545. พิมพ์ครั้งที่ 4. กรุงเทพฯ: ส่วนสิ่งพิมพ์ ฝ่ายสื่อสารองค์กร ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2542. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ชวินทร์ ลีนาบรรจง. 2539. ประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวมในประเทศไทย 2535 – 2538. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ชัยโย กรกิจสุวรรณ. 2540. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2548 เอกสารประกอบการสอนวิชาเศรษฐมิติ. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่. (เอกสารอัดสำเนา)
- ธนศักดิ์ ดันตินาคม. 2539. ปัจจัยเชิงเศรษฐศาสตร์ที่มีผลกระทบต่อดัชนีราคาลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- บริษัท หลักทรัพย์ ที เอส อี ซี จำกัด. 2549. รายชื่อหลักทรัพย์และมูลค่าทั้งหมดในกลุ่มขนส่ง. (เอกสารไม่เผยแพร่)
- บทวิเคราะห์หุ้นรายตัว แหล่งที่มา [http://www.settrade.com/S17\\_ContentList.jsp](http://www.settrade.com/S17_ContentList.jsp) 17 พฤษภาคม 2549.
- บริษัท เซทเทรด คอท คอม จำกัด. ความรู้การลงทุน. แหล่งที่มา: [http://www.settrade.com/S09\\_HtmlRedirect.jsp?txtPage=leftnav2-1](http://www.settrade.com/S09_HtmlRedirect.jsp?txtPage=leftnav2-1) 14 มกราคม 2549.

- บริษัทหลักทรัพย์ กรุงเทพรนาทร. “บทวิเคราะห์หลักทรัพย์ ASIMAR, AOT, BECL, JUTHA, PSL, RCL, THAI และ TTA”. **Hot Shot BFIT- Research Department**. (4 พฤษภาคม 2549).
- บริษัทหลักทรัพย์ สยามซีที. “Earning Result” – **Research Department**. (17 กุมภาพันธ์ 2549).
- พรอนงค์ บุษราตระกูล. 2547. การลงทุนพื้นฐานและการประยุกต์. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์แห่ง จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- ไพบุลย์ เสรีวัฒนา. 2548. “CAPM และ BETA และการนำไปใช้ในเมืองไทย.” **วารสารพัฒนาบริหาร ศาสตร์**. 1: 1-22.
- มนรัตน์ โพธิ์จิตร. 2539. การวิเคราะห์อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงจากการลงทุนในกองทุนรวมในประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- รุ่งระวี สิทธิกร. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ขนส่งในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชันของโจแฮนเซน. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วีระ ชาลิต. 2543. การเปรียบเทียบแบบจำลอง CAPM และ APT ในการอธิบายความสามารถในการทำผลตอบแทนหุ้น. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
- ศุราสินี พลอยอุ่งศรี. 2548. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Amott, Robert D. 2005. **Financial Analysis Journal**. CFA Institute. Available: <http://www.cfapubs.org/faj/issues/v61n1/pdf/f0610012a.pdf> 15 January 2006.
- Bodie, Zvi; Kane, Alex and Marcus, Alan J. 2002. **Investments**. Boston: Mcgraw-Hill/Irwan.
- CAPM and APT** Available: <http://istsocrates.berkeley.edu/~craine/econ136/Webpage/Lecture%2025%20.Multifactor%20and%20APT.pdf> 22 January 2006.
- Charemza, W. and Deadman, D. **New Direction in Economic Practice; General to Specific Modeling, Cointegration and Vector Autoregression**. Aldershot: Edward Elgar, 1992.
- Dickey, D. and Fuller, W. “Likelihood Ratio Statistics for Autoregressive Time Series with a Unit root.” **Econometrica** (1981): 987-1008. 1981.

- Enders, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series**. 2<sup>nd</sup> ed. Hoboken, NJ: John Wiley & Sons.
- Gujarati, Damodar N. 2003. **Basic Econometrics**. 4<sup>th</sup> ed. Boston: McGraw-Hill
- Haugen, Robert A. [1994-2000] **Modern Investment Theory**. 4<sup>th</sup> ed. Upper Saddle River, NJ: Prentice Hall.
- Markowitz, Harry. 1950. **All The Eggs Should Not Be Placed in The Same Basket**. Available: [http://www.igidr.ac.in/~susant/TEACHING/CITI/print\\_citi-10.pdf](http://www.igidr.ac.in/~susant/TEACHING/CITI/print_citi-10.pdf) 25 December 2005.
- Rahman, Matiur and Mustafa, Muhammad. 1997. "Dynamics of Real Export and Real Economic Growths in 13 Selected Asian Countries." **Journal of Economic Development** 16: 81-95.
- Reuters. 2005. **Reuters Kobra 3.5.1**. Available: Finance and Investment Center, Chiangmai University. 28 December 2005. "The Prize in Economic Sciences 1990" **Press Release** 2003 Available: <http://nobelprize.org/economics/laureates/1990/press.html> 19 January 2005.
- "The Prize in Economic Sciences 1990" **Press Release 2003** Available: <http://nobelprize.org/economics/laureates/1990/press.html> 19 January 2005.
- Sharpe, William F. 1964. "Capital Asset Prices : A Theory of Market Equilibrium Under Condition of Risk." **Journal of Finance** 19, 3 (September) : 425-442.