

## เอกสารอ้างอิง

- เดชวิทย์ นิลวรรณ. 2539. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่ม  
สื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจ  
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ชวินทร์ สีนาวรจง. 2539. การประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวมในประเทศไทย 2535-  
2538. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ชัยโย กรกิจสุวรรณ. 2540. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่ม  
พลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์  
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2549. เศรษฐมิตติ: เอกสารประกอบการสอน. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่. (เอกสารอัดสำเนา)
- นภเกตน์ เอี้ยวเพชรพงศ์. 2543. การวิเคราะห์ความเสี่ยง อัตราผลตอบแทนและการเลือกลงทุนใน  
หลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารโดยใช้แบบจำลอง CAPM. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์  
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- น้ำฝน เสนางคนิกร. 2544. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาด  
หลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- บุศรา บุญบุตร. 2548. การวิเคราะห์ความเสี่ยง อัตราผลตอบแทนและประเมินมูลค่าของ  
หลักทรัพย์กลุ่มพลังงานโดยใช้แบบจำลอง CAPM. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์  
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- มนรัตน์ โพธิ์วิจิตร. 2539. การวิเคราะห์อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงจากการลงทุนใน  
กองทุนรวมในประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- มัลลิกา เลิศฤทธิ. 2543. การประเมินค่าหุ้นกลุ่มพลังงาน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์  
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- บุษนา เรือนสุภา. 2543. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคาร  
พาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์  
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ร่วมเกล้า ชัยนวงษ์. 2543. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่ม  
 บันเทิงและสันทนาการในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ  
 เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ราคาน้ำมันดิบ. แหล่งที่มา <http://www.energy.go.th/th/knowledge.asp> (3 มีนาคม 2550).

รุ่งระวี สิทธิกร. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ชั้นสูงในตลาด  
 หลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชันของโจแฮนสัน. การค้นคว้าแบบอิสระ  
 เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

รุ่งรัตน์ มาบุตร. 2549. การวิเคราะห์อัตราผลตอบแทนของหุ้นในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.  
 การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

วิรัชญา ก่อเกษมสุข. 2549. การวิเคราะห์ผลตอบแทนหลักทรัพย์กลุ่มขนส่งในตลาดหลักทรัพย์  
 แห่งประเทศไทยโดยใช้แบบจำลองการตั้งราคาหลักทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระ  
 เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ศศิณี ดันรัตน์นางส์. 2544. การวิเคราะห์อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงของหลักทรัพย์ในกลุ่ม  
 ธุรกิจเกษตร. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

อภิวัฒน์ พุ่มเจริญ. 2548. การทดสอบแบบจำลองการตั้งราคาสินค้าประเภททุนสำหรับดัชนีบาง  
 หมวดในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต  
 มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

Engle, Robert E. and Granger, Clive W.J. 1987. "Cointegration and Error-Correction :  
 Representation, and Testing." *Econometrica* 55 ( March ): 251-276.

Fischer, Donald E. and Jordan, Ronald J. 1995. **Security Analysis and Portfolio Management.**  
 6<sup>th</sup> ed. New Jersey: Prentice – Hall.

Sriboonchitta, S. and Wiboonpongse, A. 2007. **On the Estimation of Varying  $\beta$  Parameter in  
 the Capital Asset Pricing Mode ( CAPM ).** Chiangmai, Thailand.