

### บรรณานุกรม

- คำชัย แก้วร่วมวงศ์. การวิเคราะห์เปรียบเทียบผลตอบแทนการลงทุนหุ้นกลุ่มพลังงานและกลุ่มสื่อสาร. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2539.
- ชัยโย ภารกิจสุวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- ชวินทร์ ลีนาบรรจง. ประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวมในประเทศไทยปี 2535-2538. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2539.
- น้ำฝน เสนางคนิกร. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2546. อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.bot.or.th>. 8 มกราคม 2546.
- พิเชษฐ พรหมสุข. ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อการเปลี่ยนแปลงของค่าพรีเมียม. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- ภคพงษ์ พุมอาภรณ์. แบบจำลองเศรษฐกิจสำหรับภาคการลงทุนของไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- ยุทธนา เรือนสุภา. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2543.
- เยาวลักษณ์ อรุณมีศรี. การลงทุนในหลักทรัพย์ของชาวต่างประเทศในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์, 2534.
- รังสรรค์ หทัยเสรี. "Co-integration and Error Correction Approach: ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของไทย." วารสารเศรษฐศาสตร์ธรรมศาสตร์ 13 (กันยายน 2538): 20-55.

- สุชาติ อุปริพทธิพงศ์. ผลกระทบของปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีต่อดัชนีตราสารหนี้. วิทยานิพนธ์  
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2542.
- สุโลจน์ ศรีแก้ว. ปัจจัยที่มีความสัมพันธ์ต่อดัชนีราคาหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์. วิทยา  
นิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2535.
- สังข์พันธุ์ คุรุภากรณ์. ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์  
แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่,  
2540.
- อานวย สียาทิพย์กุล. การวิเคราะห์หลักทรัพย์. กรุงเทพฯ: อมรินทร์การพิมพ์, 2521.
- David, Dicky A. and Fuller, Wayne A. "Distribution of the Estimators for Autoregressive  
Time Series with a Unit Root." *Journal of the American Statistical  
Association* 74 (June 1979): 427 – 431.
- Fischer, Donald E. and Jordan, Ronald J. *Securities Analysis and Portfolio Management*.  
Englewood Cliffs, NJ: Prentice-Hall, 1995.
- Schwert, G. William. "Test of Unit Roots: A Monte Carlo Investigation." *Journal of  
Business and Economics Statistics* 7 (1989): 147 – 159.
- Sharpe, William F.; Alexander, Gordon J. and Bailey, Jeffery V. *Investment*. Englewood  
Cliffs, NJ: Prentice-Hall, 1995.
-