

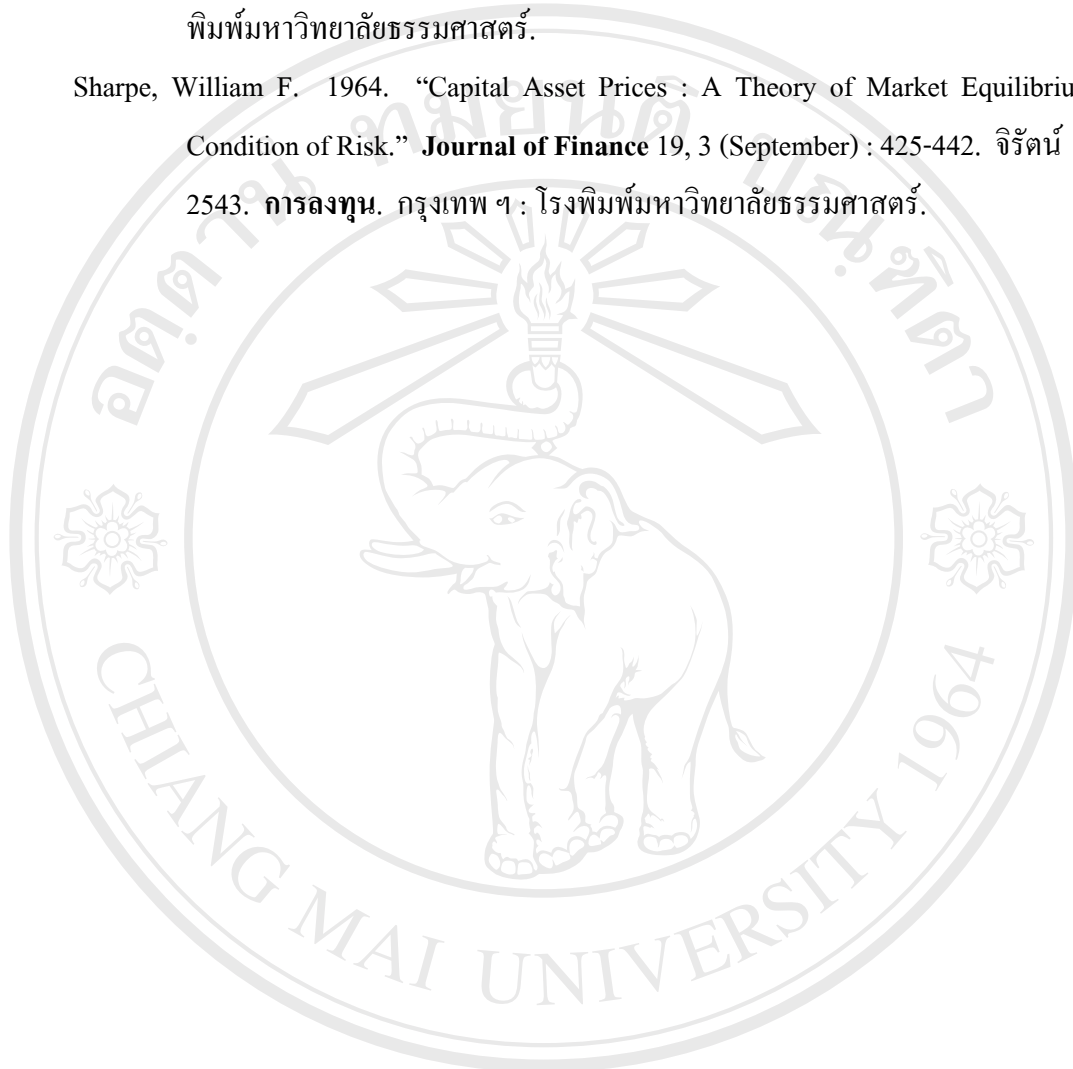
เอกสารอ้างอิง

- จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2543. การลงทุน. กรุงเทพฯ : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2546. การวิเคราะห์หลักทรัพย์โดยใช้ปัจจัยพื้นฐาน.
กรุงเทพฯ : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2548. การลงทุนในตราสารทุน. กรุงเทพฯ : สถาบันพัฒนา
ความรู้ตลาดทุน.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. แหล่งความรู้นักลงทุน. แหล่งที่มา : [http://www.set.or.th/
th/education/fundamentals/fundamental_p1.html](http://www.set.or.th/th/education/fundamentals/fundamental_p1.html) 11 มกราคม 2549.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. “พฤติกรรมการณ์ส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดค้าส่ง
โตเกี่ยวกับตลาดค้าปลีกในประเทศไทย”. วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
3 (กันยายน-ธันวาคม 2542) : 16-15.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2548. เอกสารประกอบการสอนวิชาเศรษฐมิติ. เชียงใหม่, คณะเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่. (เอกสารอัดสำเนา).
- ชนศักดิ์ ต้นดินาคม. 2539. ปัจจัยเชิงเศรษฐศาสตร์ที่มีผลกระทบต่อดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์
แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ชนิดา กาญจนพันธุ์. 2534. ผลกระทบของปัจจัยทางเศรษฐกิจต่อราคาหุ้นของไทย. วิทยานิพนธ์
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. ข้อมูลเปรียบเทียบหมวดอุตสาหกรรม. แหล่งที่มา :
http://www.setsmart.com/ism/ism_sectorcomparison.jsp 11 มกราคม 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) 11 มกราคม 2549.
- บุญศรี ศรีหิรัญกุล. 2539. ปัจจัยที่มีผลกระทบต่ออัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในหลักทรัพย์.
การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปาริชาติ โภชนจันทร์. 2547. การวิเคราะห์การลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยตาม
ทฤษฎีการกำหนดราคาแบบเอพีทีโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระ
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- พรทิพย์ เลี่ยมหาญ. 2542. การศึกษาปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีผลกระทบต่อ การเปลี่ยนแปลง ราคาหุ้น กรณีศึกษา กลุ่มธนาคารพาณิชย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เพชร ชุมทรัพย์. 2544. หลักการลงทุน. กรุงเทพฯ : สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- มัลลิกา ชีระโกวิท. 2546. การวิเคราะห์การลงทุนแบบเอทีพีของหุ้นในดัชนีกลุ่ม 50 หลักทรัพย์ ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- รังสรรค์ หทัยเสรี. 2538. **Cointegration and Error Correction Approach : ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของไทย.** วารสารเศรษฐศาสตร์ ธรรมศาสตร์.
- รุ่งระวี สิทธิกร. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ขนส่งในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชันของโจแฮนเซน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วีระ ชาลิต. 2543. การเปรียบเทียบแบบจำลอง CAPM และ APT ในการอธิบายความสามารถในการทำนายผลตอบแทนหุ้น. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- สุโลจณี ศรีแก้ว. 2535. การวิเคราะห์หุ้นกลุ่มธนาคารและกลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สุนทรี กัลชาญพิเศษ. 2539. การตัดสินใจลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยใช้แบบจำลอง Arbitrage Pricing Theory (APT). วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Dickey, D. and Fuller, W. 1981. "Distribution to the Estimates for Autoregressive Time Series with Unit Root." **Journal of American Statistic Association** 74: 427-431.
- Enders, W. 1995. **Applied Economic Time Series.** New York : Low University.
- Engle, Robert E. and Granger, Clive W.J. 1987. "Cointegration and Error – Correction : Representation, Estimation and Testing." **Econometrica** 55 (March) : 251- 276.
- Roll,Richard and Stephen A. Ross. 1980. "An Empirical Investigation of the arbitrage Pricing Theory." **Journal of Finance** 35, 5 (December): 1073-1103. จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2543. การลงทุน. กรุงเทพฯ : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

Ross, Stephen A. 1976. “The arbitrage Theory of Capital Asset Pricing.” **Journal of Economic Theory** (December): 343-362. จีรัตน์ สังข์แก้ว. 2543. การลงทุน. กรุงเทพฯ ฯ : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

Sharpe, William F. 1964. “Capital Asset Prices : A Theory of Market Equilibrium Under Condition of Risk.” **Journal of Finance** 19, 3 (September) : 425-442. จีรัตน์ สังข์แก้ว. 2543. การลงทุน. กรุงเทพฯ ฯ : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved