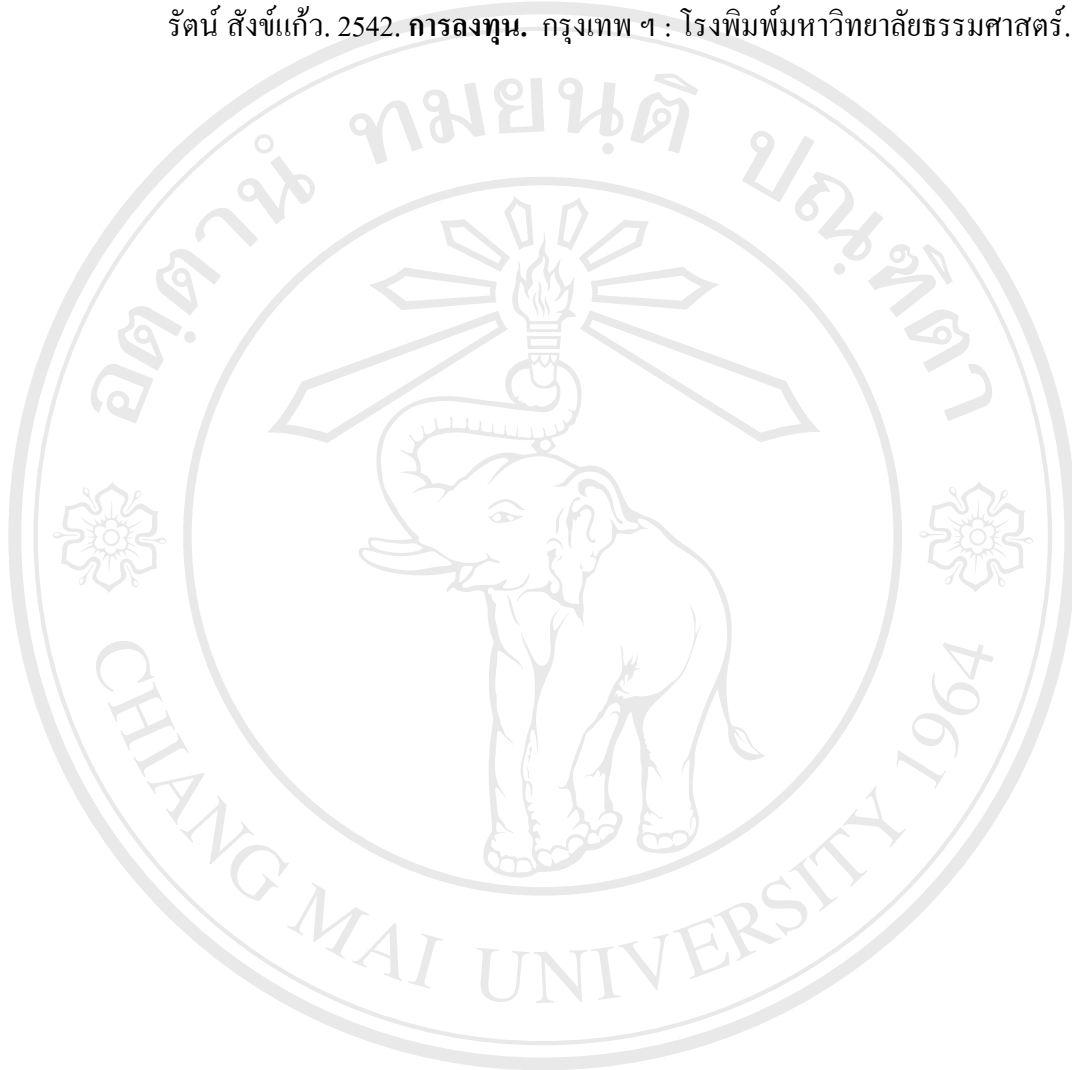


เอกสารอ้างอิง

- การวิเคราะห์หลักทรัพย์โดยใช้ปัจจัยพื้นฐาน. 2545. พิมพ์ครั้งที่ 4. กรุงเทพฯ: ส่วนสิ่งพิมพ์ ฝ่ายสื่อสารองค์กร ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- จิรัตน์ ตั้งขันธ์แก้ว. 2542. การลงทุน. กรุงเทพฯ : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2548. เอกสารประกอบการสอนวิชาเศรษฐมิติ. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่. (เอกสารถ่ายสำเนา)
- ชนศักดิ์ ต้นดินาคม. 2539. ปัจจัยเชิงเศรษฐศาสตร์ที่มีผลกระทบต่อดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ธนิดา กาญจนพันธุ์. 2534. ผลกระทบของปัจจัยทางเศรษฐกิจต่อราคาหุ้นของไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- บุญศรี ศรีหิรัญกุล. 2539. ปัจจัยที่มีผลกระทบต่ออัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในหลักทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปาริชาติ โภชนจันทร์. 2547. การวิเคราะห์การลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยตามทฤษฎีการกำหนดราคาแบบเอฟอีทีโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- พรทิพย์ เสี่ยมหาญ. 2542. การศึกษาปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีผลกระทบต่อการเปลี่ยนแปลง ราคาหุ้น กรณีศึกษา กลุ่มธนาคารพาณิชย์. วิทยานิพนธ์บริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเกษมบัณฑิต.
- พริ้มเพรา มณีศรีวงศ์กุล. 2548. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อผลตอบแทนของหุ้นในกลุ่มยานพาหนะและชิ้นส่วนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยแบบจำลองฟาร์มาและเฟรนช์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- มัลลิกา ชีระ โกวิท. 2546. การวิเคราะห์การลงทุนแบบเอฟอีทีของหุ้นในดัชนีกลุ่ม 50 หลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เริงชัย ต้นสุชาติ. 2546. เศรษฐมิติ. เชียงใหม่: คณะธุรกิจการเกษตร มหาวิทยาลัยแม่โจ้.

- วิบูลย์ กิตติลักษณ์วงศ์. 2540. การศึกษาผลกระทบของปัจจัยทางเศรษฐกิจและปัจจัยทางเทคนิคต่อดัชนีราคาของหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์.
- วีระ ชวลิต. 2543. การเปรียบเทียบแบบจำลอง CAPM และ APT ในการอธิบายความสามารถในการทำนายผลตอบแทนหุ้น. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- สุนทรี่ กัลชาญพิเศษ. 2539. การตัดสินใจลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้แบบจำลอง Arbitrage Pricing Theory (APT). วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Bartholdy, Jan and Peare, Paula. 2003. **Estimation of Expected Return: CAPM vs Fama and French.** Aarhus (Den.): Department of Economics University of Aarhus.
- Dickey, D. and Fuller, W. 1979. "Distribution to the Estimates for Autoregressive Time Series with Unit Root." **Journal of American Statistic Assosiation.** 74: 427-431.
- Enders, W. 1995. **Applied Economic Time Series.** New York: Iowa University.
- Engle, Robert E. and Granger, Clive W.J. 1987. "Cointegration and Error – Correction: Representation, Estimation and Testing." **Econometrica** 55 (March): 251- 276.
- Faff, Robert W. 2001. "An Extimation of the Fama and French Three-Factor Model Using Commercially Available Factors." **Australian Journal of Management** 26 ,1 (June) : 1-18.
- Fama, E.F. and French, K.R. 1992. " The Cross-section of Expected Stock Return. " **Journal of Finance** 47: 427-465
- Fischer, Donald E. and Jordan, Ronald J. 1995. **Security Analysis and Portfolio Management.** 6th ed. Englewood Cliffs, NJ: Prentice-Hall.
- Roll & Asset Management Corporation. 1986. "An Empirical Investigation of the Arbitrage Pricing Theory." **Journal of Finance** 35, (December): 1073-1103. อ้างถึงใน จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2542. การลงทุน. กรุงเทพฯ ฯ : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- Ross, Stephen A. 1976. "The Arbitrage Theory of Asset Pricing." **Journal of Economic Theory** (December): 343-362

Sharp, William F. 1964. "Capital Asset Prices: A Theory of Market Equilibrium Under Conditions of Risk." **Journal of Finance** 19, no.3 (September): 425-442. อ้างถึงใน วิจารณ์ สังข์แก้ว. 2542. การลงทุน. กรุงเทพฯ : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved