

เอกสารอ้างอิง

- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. “พฤติกรรมกรรมการส่งผ่านราคาหุ้นในตลาด
ค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย”. วารสารเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 3: 16-51.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2548. เอกสารประกอบการสอนวิชาเศรษฐมิติ. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ธนิดา กาญจนพันธุ์. 2534. ผลกระทบของปัจจัยทางเศรษฐกิจต่อราคาหุ้นของไทย. วิทยานิพนธ์
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- บุญชัย เกียรติธนาวิทย์. 2533. ปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีอิทธิพลต่อราคาหุ้นกลุ่มธนาคารพาณิชย์และ
บริษัทเงินทุนและหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิตมหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- บุญศรี ศรีหิรัญกุล. 2539. ปัจจัยที่มีผลกระทบต่ออัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในหลักทรัพย์. การ
ค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปาริชาติ โภชนจันทร์. 2547. การวิเคราะห์การลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยตามทฤษฎี
การกำหนดราคาแบบเอพีทีโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่. 2547.
- พรทิพย์ เขียวศรีวิทย์. 2544. ตลาดการเงินและสถาบันการเงิน. คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- พรทิพย์ เสี่ยมหาญ. 2542. การศึกษาปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีผลกระทบต่อการเปลี่ยนแปลงราคาหุ้น
กรณีศึกษา กลุ่มธนาคารพาณิชย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- มัลลิกา ชีระโกวิท. 2546. การวิเคราะห์การลงทุนแบบเอพีทีของหุ้นในดัชนีกลุ่ม 50 หลักทรัพย์ของ
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ยุธนา เรือนสุภา. 2539. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์
ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- ยุวดี กันทะมุล. 2548. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโครอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สุนทร กัลชาวุฒิพิเศษ. 2539. การตัดสินใจลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้แบบจำลอง Arbitrage Pricing Theory (APT). วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สุโลจณี ศรีแก้ว. 2535. การวิเคราะห์หุ้นกลุ่มธนาคารและกลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2549. มูลค่าเงินลงทุนของหลักทรัพย์กลุ่มการเงิน. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th/set/sectorquotation.do?sector=0&industry=3> วันที่ 3 กุมภาพันธ์ 2549
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2549. ผลประกอบการของหลักทรัพย์ในกลุ่มการเงิน. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th/set/companyinfo.do?type=highlight> วันที่ 3 กุมภาพันธ์ 2549
- สถาบันวิจัยเพื่อพัฒนาประเทศไทย. 2549. สินเชื่อที่ไม่ก่อให้เกิดรายได้. แหล่งที่มา: http://www.info.tdri.or.th/kit_web/t16.pdf วันที่ 3 กุมภาพันธ์ 2549
- Dickey, D. and Fuller, W. 1981. "Lilelihood Ratio Statistics for Autoregressive Time Series with a Unit Root." **Econometrica** 49: 1057-1072.
- Enders, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series**. New York: John Wiley & Sons.
- Gujarati, D. 1995. **Basics Econometrics**. 3rd ed. New York: McGraw-Hill.
- Johansen, S. 1988. "Statistical Analysis of Cointegration Vectors." **Journal of Economic Dynamics and Control** 12: 90-100.
- Johnston, J. and Dinardo, J. 1997. **Econometric Methods**. 4th ed. New York: McGraw-Hill.
- Pindyck, and Rubinfeld. 1998. **Econometric Models and Economic Forecasts**. 4th ed. New York: McGraw-Hill.
- Ross, Stephen. 1976. "The Arbitrage Theory of Capital Asset Pricing." **Journal of Economic Theory** 13: 341-360.