

## บรรณานุกรม

- กัลยา วาณิชย์บัญชา. 2545. การวิเคราะห์ข้อมูลสำหรับตัวแปรหลายตัวด้วย SPSS for Windows. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์กรุงเทพ.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2544. การลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 4. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์กรุงเทพ.
- ชัยโย ภารกิจสุวรรณ. 2540. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ดวงใจ วิสกุล. 2538. สถิติธุรกิจ. พิมพ์ครั้งที่ 6. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
- ดัชนีราคาผู้บริโภค. 2546. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.price.moc.go.th>. 2 มีนาคม 2546.
- เดชวิทย์ นิลวรรณ. 2539. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2545. เอกสารประกอบการสอนวิชาเศรษฐมิติ. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่. (อัดสำเนา)
- “เทคนิคการเล่นหุ้น.” 2536. การเงินการธนาคาร. 12, 133 (พฤษภาคม): 1-18.
- ธนศักดิ์ ดันดินาคม. 2539. ปัจจัยเชิงเศรษฐศาสตร์ที่มีผลกระทบต่อดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ธนิดา กาญจนพันธ์. 2534. ผลกระทบของปัจจัยทางเศรษฐกิจต่อราคาหุ้นของไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- นินนาท เจริญเลิศ. 2532. ปัจจัยกำหนดการลงทุนในหลักทรัพย์และแนวทางการพัฒนาตลาดหลักทรัพย์ในอนาคต. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- บริษัทผลิตไฟฟ้าราชบุรีโฮลดิ้ง จำกัด (มหาชน). 2546. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.sec.or.th>. 30 เมษายน 2546.

- บริษัทปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน). 2546. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา:  
<http://www.sec.or.th>. 31 เมษายน 2546.
- บุญศรี ศรีธีรฤฎ. 2539. ปัจจัยที่มีผลกระทบต่ออัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในหลักทรัพย์.  
 การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- พรทิพย์ เสียมหาญ. 2542. การศึกษาปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีผลกระทบต่อการเปลี่ยนแปลงของราคา  
 หุ้นกรณีศึกษากลุ่มธนาคารพาณิชย์. วิทยานิพนธ์บริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัย  
 เกษมบัณฑิต.
- วิโชติ ตั้งศักดิ์พร. 2540. การปรับตัวของอัตราดอกเบี้ยระยะสั้นในประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐ  
 ศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- สุนทรี กัลชาญพิเศษ. 2539. การตัดสินใจลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้แบบ  
 จำลอง Arbitrage Pricing Theory (APT). วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต  
 มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สุโลจน์ ศรีแก้ว. 2535. การวิเคราะห์หุ้นกลุ่มธนาคารและกลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์  
 เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อัตราดอกเบี้ยเงินให้สินเชื่อ. 2546. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.bot.or.th>. 2 มีนาคม  
 2546.
- เอิร์ดแมน, พอล. 2544. เล่าเรื่องเงินปนเรื่องหุ้น. วีระ ชีริกัทร แปลและเรียบเรียง. กรุงเทพฯ: โรง  
 พิมพ์กรุงเทพ.
- Antoniou, A. Garrett, I. and Priestley, R. "Macroeconomic Variables as Common Pervasive  
 Risk Factors and The Empirical Content of The Arbitrage Pricing Theory."  
*Journal of Empirical Finance* 5, 3 (September 1998): 221-240.
- Charemza, Wojciech W. and Deadman, Derek F. 1993. *New Directions in Econometric  
 Practice : General to Specific Modeling, Cointegration and Vector  
 Autoregression*. 2<sup>nd</sup>. Vermont: Edward Elgar Publishing Limited.
- Connor, G. "The Three Types of Factor Models: A Comparison of Their Explanatory  
 Power." *Financial Analyst Journal* 51, 3 (May/June 1995): 42-46.
- Enders, W. 1995. *Applied Econometric Time Series*. New York: John Wiley & Sons.
- Gujarati, Damodar N. 1995. *Basic Econometrics*. 3<sup>rd</sup> ed. New York: McGraw-Hill.

- Ong, Seow-Eng; Yong, Yan Yi. "Real estate exposure and asset intensity." **Journal of Real Estate Portfolio Management** 6, 1 (2000): 27-35.
- Reuters. 2003. **Reuters Kobra 3.5.1**. [Online]. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 6 March 2003.
- Roll, Richard; Ross, Stephen A. "The arbitrage pricing theory approach to strategic portfolio planning." **Financial Analysts Journal** 51, 1 (Jan/Feb 1995): 122-131.
- Veera Chawalit. 2000. **Comparison Between CAPM and APT to Explain the Predictability of Stock Return**. Master's thesis. Economics, Chulalongkorn University.
- Wongbangpo, P. and Subhash, C. "Stock Market and Macroeconomic Fundamental Dynamic Interactions: ASEAN-5 Countries." **Journal of Asian Economics** 3, 1 (January – February 2002): 27-51.
-