

## เอกสารอ้างอิง

- กนกกาญจน์ ทวีอภิรดีเจริญ. **ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อราคาหุ้นหมวดอสังหาริมทรัพย์**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2541
- ขวัญหล้า จันทะพันธ์. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. **การลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 4**. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2544.
- ชาญณรงค์ ชัยพัฒน์. **อิทธิพลของนักลงทุนที่มีต่อดัชนีราคาหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและปัจจัยที่มีผลกระทบต่อมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของนักลงทุน**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539
- เดชวิทย์ นิลวรรณ. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสาร**. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. “พฤติกรรม การส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดระหว่างตลาดค้าส่งโตเกียวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” **วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่** 3(กันยายน-ธันวาคม 2542):16-15
- ธนศักดิ์ ดันดินาคม. **ปัจจัยทางเศรษฐศาสตร์ที่มีผลกระทบต่อดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2546. **ดัชนีการลงทุนภาคเอกชน**. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา : <http://www.bot.or.th>. 9 พฤษภาคม 2546.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2546. **ดัชนีราคาผู้บริโภค**. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา : <http://www.bot.or.th>. 9 พฤษภาคม 2546.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2546. **อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงธนาคารพาณิชย์**. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา : <http://www.bot.or.th>. 9 พฤษภาคม 2546.
- นินนาท เจริญเลิศ. **ปัจจัยกำหนดการลงทุนในหลักทรัพย์และแนวทางการพัฒนาตลาดหลักทรัพย์ในอนาคต**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2532.
- บุญชัย เกียรติธนวิทย์. **ปัจจัยทางเศรษฐศาสตร์ที่มีผลกระทบต่อราคาหุ้นกลุ่มธนาคารพาณิชย์และกลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2534.

- บุญศรี ตีรหิรัญกุล. **ปัจจัยที่มีผลกระทบต่ออัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในหลักทรัพย์**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539
- พรทิพย์ เลี่ยมหาญ. **การศึกษาปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีผลกระทบต่อการเปลี่ยนแปลงของราคาหุ้นกลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2542.
- เพชร ชุมทรัพย์. **หลักการลงทุน**. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2544
- มัลลิกา ชีระโกวิท. **การวิเคราะห์การลงทุนแบบเอพีทีของหุ้นในดัชนีกลุ่ม 50 หลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- รุ่งระวี สิทธิกร. **ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ขนส่งในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชันของโจแฮนเซน**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- วิทวัส สุวรรณทา. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์บริษัทเงินทุนหลักทรัพย์บางหุ้นในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- วิภาวี อุบลฉาย. **ปัจจัยทางเศรษฐศาสตร์มหภาคที่มีอิทธิพลต่อดัชนีกลุ่ม 50 หลักทรัพย์หลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- วิสุมิตรา วงศ์เลี้ยงถาวร. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มอสังหาริมทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชันและ เฮอร์คอร์เรชัน**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- สุนทรี กัลชาญพิเศษ. **การตัดสินใจลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยอาศัยแบบจำลอง Arbitrage Pricing Theory (APT)**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- สถาบันพัฒนาบุคลากรธุรกิจหลักทรัพย์ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. **หลักสูตรความรู้พื้นฐานเกี่ยวกับตลาดเงินและตลาดทุน**. พิมพ์ครั้งที่ 1. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์สุโขมวิทมีเดีย, 2546.

- Dickey, D. and Fuller, W. "Distribution to the Estimates for Autoregressive Time Series with Unit Root." **Journal of American Statistic Association** 74 (1979): 427-431.
- Chen ,Nai-Fu. "Some empirical tests of the Theory of Arbitrage Pricing " **Journal of Finance**.(December 1989) : 1393-1414.
- Connor ,G. "The three type of Factor Model : A Comparison of Their Explanatory power ." **Finance Analysts Journal** 51,3 (May - June 1995) : 42-46.
- Ender, W. **Applied Econometric Time Series**. New York: John Wiley & Sons, 1995.
- Gujarati, D. **Basic Econometrics**. 3<sup>rd</sup> ed. New York: McGraw-Hill, 1995.
- Johnston, J. **Econometric Methods**. 3<sup>rd</sup> ed. Singapore: McGraw-Hill, 1984.
- Maddala, G.S. **Introduction of Econometrics**. 2<sup>nd</sup> ed. New York: Macmillan, 1992.
- Mackinnon, J.G. Critical Values for Cointegration tests. In **Long-run Economic Relationship: Readings in Cointegration**. Edited by R. Engle and Clive W. Granger. Oxford: Oxford University Press, 1991. pp. 267-276.
- Studenmund, A.H. **Using Econometrics**. 3<sup>rd</sup> ed. Reading, MA: Addison-Wesley, 1997.
- Reuter. **Reuters Kobra 3.5.1**. [Online]. Available : Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 9 November 2003.
- Roll, Richard and Ross, Stephen A. " An Empirical Investigation of the Arbitrage Pricing Theory" **Journal of Finance**. 35, 5 (December 1980) : 1073-1103.
- \_\_\_\_\_. "The Arbitrage Pricing Theory Approach to Strategic Portfolio Planning." **Finance Analysts Journal** (May - June 1984) : 14-26.
- \_\_\_\_\_. "Regulation, the Capital Asset Pricing Model, And the Arbitrage Pricing Theory." **Public Utilities Fortnightly** (May 1983) : 1073-1103.
- Ross , Stephen A. **The Arbitrage Pricing Theory : Corporate Finance**. 6<sup>th</sup> ed. McGraw-Hill Irwin, 2002.