

### บรรณานุกรม

- กนกกาญจน์ ทวีอภิรดีเจริญ. 2541. ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อราคาหุ้นหมวดอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2540.
- เจน ประสิทธิ์ล้ำค่า. 2526. พฤติกรรมการเคลื่อนไหวของราคาหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2542. ฐักกับตลาดหลักทรัพย์. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. “พฤติกรรมการส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดระหว่างตลาดค้าส่งโตเกียวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 3 ( กันยายน – ธันวาคม ): 16-51.
- ทรงศิริ แต่สมบัติ. 2541. การวิเคราะห์การถดถอย. พิมพ์ครั้งที่ 2. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2546. อัตราดอกเบี้ยพันธบัตรรัฐบาล. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: [http://www.bot.or.th/bothomepage/databank/FinMarkets/Bond/Bid\\_Yield03.xls](http://www.bot.or.th/bothomepage/databank/FinMarkets/Bond/Bid_Yield03.xls). 15 พฤษภาคม 2546.
- นารุณยาน เปี่ยม. 2538. หลักการลงทุน. กรุงเทพฯ: พี.เอ็น.การพิมพ์.
- นินนาท เจริญเลิศ. 2532. ปัจจัยกำหนดการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์ และแนวทางการพัฒนาตลาดหลักทรัพย์ในอนาคต. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- บุญศรี ตีร์ธีบุญกุล. 2539. ปัจจัยที่มีผลกระทบต่ออัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปวีณา คำพุกกะ. 2545. การวิเคราะห์ดัชนีหุ้นไทยโดยวิธีการถดถอยแบบสวิตซิง. การค้นคว้าแบบอิสระวิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชาสถิติประยุกต์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เพชร ชุมทรัพย์. 2540. หลักการลงทุน. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

- ชูธรรนา เรือนสุภา. 2543. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วันรักษ์ มิ่งมณีนาคิน. 2540. พจนานุกรมศัพท์เศรษฐศาสตร์. พิมพ์ครั้งที่ 5. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- สุโลจน์ ศรีแก้ว. 2535. การวิเคราะห์หุ้นกลุ่มธนาคารและกลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์. 2546. แบบรายงาน 56-1. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: [http://www.sec.or.th/corp\\_fin/cgi-bin/find56.php](http://www.sec.or.th/corp_fin/cgi-bin/find56.php). 30 เมษายน 2546.
- หทัยรัตน์ บุญโญ. 2541. การประมาณค่าเบต้าในแบบจำลองการกำหนดราคาสินทรัพย์ประเภทหุ้น. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Enders, W. 1995. **Applied Econometric Time Series**. New York: John Wiley & Sons.
- Fischer, E. and Ronald, J. **Securities Analysis and Portfolio Management**. Englewood Cliffs, NJ: Prentice-Hall, 1995.
- Maddala, G.S. and In-Moo Kin. 1998. **Unit Roots Cointegration and Structural Change**. New York: Cambridge University Press.
- Reuters. 2002. **Reuters Kobra 3.5.1**. [Online]. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 27 December 2002.