

## บรรณานุกรม

- กนกกาญจน์ ทวีอภิระเจริณ. ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อราคาหุ้นหมวดอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2541.
- ขวัญชนก ธรรมวิวรรณ์. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์กับเครื่องชี้เศรษฐกิจมหภาค. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2543.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2544.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. ก้าวแรกสู่การลงทุนในตลาดหลักทรัพย์. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย, 2541.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และ อารี วิบูลย์พงศ์. “พฤติกรรมการส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดระหว่างตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 3 (กันยายน – ธันวาคม 2542): 16 – 51.
- ธนศักดิ์ ต้นดินาคม. ปัจจัยเชิงเศรษฐศาสตร์ที่มีผลกระทบต่อดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ธีระ เศรษฐเสถียร. การตัดสินใจลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยของนักลงทุนรายย่อยในจังหวัดเชียงใหม่. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- นินนาท เจริญเลิศ. ปัจจัยกำหนดการลงทุนในหลักทรัพย์และแนวทางการพัฒนาตลาดหลักทรัพย์ในอนาคต. วิทยานิพนธ์มหาบัณฑิต คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2532.
- เบ็ญจวรรณ ไชยยันต์. การลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยในจังหวัดเชียงใหม่. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.

- พิเชษฐ พรหมสุข. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อค่าพรีเมียมและค่าชดเชยความเสี่ยงในการซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- พิเชษฐ สิทธิสมบัติ. การลงทุนในหลักทรัพย์จากต่างประเทศในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- พิงพิศ แก้วเพชร. ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อการเลือกลงทุนในหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยของนักลงทุนในจังหวัดเชียงใหม่. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ภัทรภา โทเจริญ. การศึกษาเปรียบเทียบตลาดตราสารหนี้ไทยกับต่างประเทศ. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- เรืองฤดี อุดมอนุสรณ์. ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อการตัดสินใจซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ลงทุนในจังหวัดเชียงใหม่. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ศุภกร สุนทรกิจ. ความรู้เชิงปฏิบัติสำหรับการลงทุนในหุ้น. กรุงเทพฯ: เม็ดทรายพริ้นติ้ง, 2539.
- อัมพวัน นันทขว้าง. ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยของนักลงทุนรายย่อยในจังหวัดเชียงใหม่. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2545.
- 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.
- อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และ อารี วิบูลย์พงศ์. "พฤติกรรมการณ์ส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดระหว่าง ตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าบรรจในประเทศไทย." *วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่* 3 (กันยายน – ธันวาคม 2542): 16 – 51.
- Enders, W. *Applied Econometric Time Series*. New York: John Wiley & Sons, 1995.
- Engle, R.F. and Granger, C.W.J. "Co-integration and Error Correction: Representation, Estimation, and Testing." *Econometrica* 55, 2(March 1987): 251-276.
- Gujarati, D. *Basic Econometrics*. 3<sup>rd</sup> ed. New York: McGraw-Hill, 1995.
- Johnston, J. *Economic Methods*. 3<sup>rd</sup> ed. Singapore: McGraw-Hill, 1984.
- MacKinnon, J.G. "Critical Values for Cointegration Test." In *Long-run Economic Relationships: Reading in Cointegration*. Edited by R.F. Engle and C.W.J.

Granger. Oxford: Oxford University Press. pp.267-276, 1991.

Brown, P. and Ball, R. "Some Preliminary Findings on the Association Between the Earning of a firm, Its Industry and the Economy," **Empirical Research in Accounting, Selected Studies**, 5(1976): 55-77. อ้างถึงใน จิรัตน์ สัจจ์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2544.

Reuters. 2003. Reuters Kobra 3.5.1. [Online]. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 25 February 2003.

---

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
Chiang Mai University