

เอกสารอ้างอิง

กจิพัฒน์ ทศวิไล. การศึกษาปัจจัยพื้นฐานที่มีอิทธิพลต่อราคาหลักทรัพย์ในกลุ่มธนาคารพาณิชย์
กรณีศึกษานาการกรุงเทพ จำกัด (มหาชน). การศึกษาค้นคว้าด้วยตนเองบริหารธุรกิจ
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเกษมบัณฑิต, 2539

จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2543. การลงทุน. กรุงเทพฯ : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2546. การวิเคราะห์หลักทรัพย์โดยใช้ปัจจัยพื้นฐาน.

_____. 2548. การลงทุนในตราสารทุน. กรุงเทพฯ : สถาบันพัฒนาความรู้ตลาดทุน. กรุงเทพฯ :
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

_____. การวิเคราะห์หลักทรัพย์โดยใช้ปัจจัยพื้นฐาน. กรุงเทพฯ : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย,
2545.

ทมาภรณ์ กรองแก้ว. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคาร
พาณิชย์ขนาดใหญ่ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. เอกสารประกอบการสอนวิชาเศรษฐมิติ. เชียงใหม่. คณะเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2548.

ทิวรัตน์ ต.เจริญ. 2548. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มการแพทย์ใน
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้แบบจำลองฟาร์มาและเฟรนช์. การค้นคว้าแบบ
อิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ชนศักดิ์ ต้นดินาคม. ปัจจัยเชิงเศรษฐศาสตร์ที่มีผลกระทบต่อดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์แห่ง
ประเทศไทย. เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.

นินนาท เจริญเลิศ. 2532. ปัจจัยการกำหนดการลงทุนในหลักทรัพย์และแนวทางการพัฒนาตลาด
หลักทรัพย์ในอนาคต. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

บริษัท เซทเทรด คอท คอม จำกัด. 2543. บริษัท อุตสาหกรรมปิโตรเคมีกัล จำกัด(มหาชน). บท
วิเคราะห์. แหล่งที่มา: <http://www.settrade.com>. 14 มกราคม 2549.

- ปาริชาติ โภชนจันทร์. การวิเคราะห์การลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยตามทฤษฎีการกำหนดราคาแบบเอพีทีโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547
- ปิยรัตน์ ยงทรัพย์สินธุ์. การประเมินมูลค่าหลักทรัพย์โดยวิธีการวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐาน : กรณีศึกษา บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน). การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- พรทิพย์ เสี่ยมหาญ . การศึกษาปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีผลกระทบต่อ การเปลี่ยนแปลง ราคาหุ้น กรณีศึกษา กลุ่มธนาคารพาณิชย์ การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2542.
- เพชร ชุมทรัพย์. 2544. หลักการลงทุน. กรุงเทพฯ : สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์. กรุงเทพฯ : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- มัลลิกา ชีระโกวิท. การวิเคราะห์การลงทุนแบบเอพีทีของหุ้นในดัชนีกลุ่ม 50 หลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- รสสุณีย์ ช่างมดโสภา. การวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานและการประเมินมูลค่าแท้จริงของหลักทรัพย์กลุ่มอุตสาหกรรมปูนซีเมนต์. การศึกษาค้นคว้าด้วยตนเองบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเกษมบัณฑิต, 2541.
- รุ่งระวี สิทธิกร. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ขนส่งในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชันของโจแฮนเซน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วิภาวี อุบลฉาย. 2546. ปัจจัยทางเศรษฐศาสตร์มหภาคที่มีอิทธิพลต่อดัชนีกลุ่ม 50 หลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. . การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ศิชา กอလာภประเสริฐ. การศึกษาถึงพฤติกรรมและปัญหาการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยของนักลงทุนรายใหม่ ในเขตอำเภอเมือง จังหวัดเชียงใหม่. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547.
- สุนทรี่ กัลชาญพิเศษ. การตัดสินใจลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยใช้แบบจำลอง Arbitrage Pricing Theory (APT). วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.

สุโลจน์ ศรีแก้ว. 2535. การวิเคราะห์หุ้นกลุ่มธนาคารและกลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

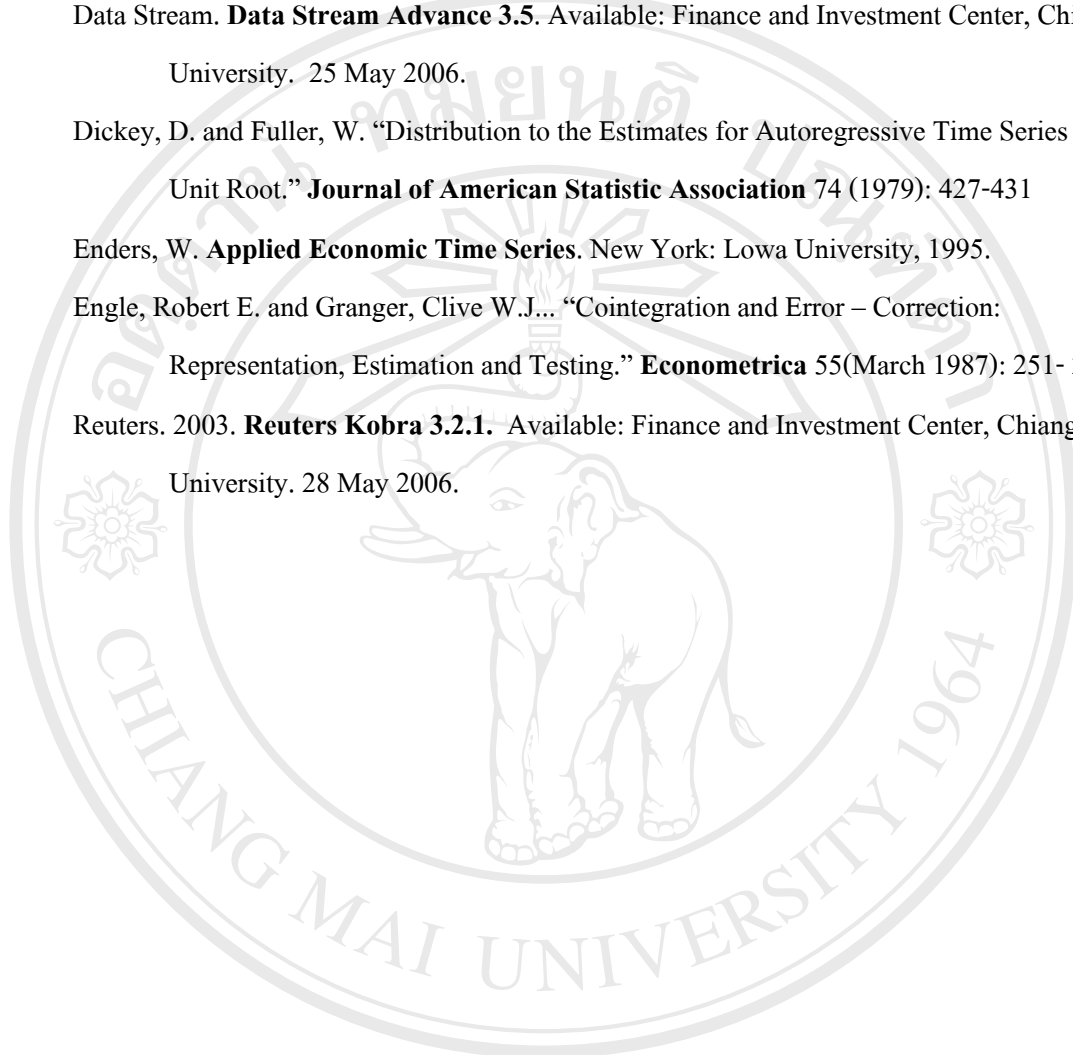
Data Stream. **Data Stream Advance 3.5**. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai
University. 25 May 2006.

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

Enders, W. **Applied Economic Time Series**. New York: Iowa University, 1995.

Engle, Robert E. and Granger, Clive W.J... "Cointegration and Error – Correction:
Representation, Estimation and Testing." **Econometrica** 55(March 1987): 251- 276.

Reuters. 2003. **Reuters Kobra 3.2.1**. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai
University. 28 May 2006.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved