

## บรรณานุกรม

### หนังสือและบทความในหนังสือ

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตร, เศรษฐกิจมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์ (พิมพ์ครั้งที่ 1). เชียงใหม่ : คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547.

ทวี รื่นจินดา, สถิติเศรษฐศาสตร์ ภาควิชาสถิติและคอมพิวเตอร์. คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยรามคำแหง กรุงเทพมหานคร : สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยรามคำแหง, 2537.

พรอนงค์ บุษราตระกูล, การลงทุนพื้นฐานและการประยุกต์. กรุงเทพฯ : โรงพิมพ์จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2548.

มารวย ผดุงสิทธิ์, ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย อดีต ปัจจุบันและอนาคต. กรุงเทพฯ : บริษัทอมรินทร์พริ้นติ้งแอนด์พับลิชชิ่ง จำกัด (มหาชน), 2548.

ศิริชัย พงษ์วิชัย, การวิเคราะห์ข้อมูลทางสถิติด้วยคอมพิวเตอร์. กรุงเทพมหานคร : โรงพิมพ์จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2539.

ศิริลักษณ์ เล็กสมบุญ, การวิเคราะห์อนุกรมเวลา. คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ มหาสารคาม, 2531.

ศุภชัย ศรีสุชาติ, ข่าวสารข้อมูลเพื่อการตัดสินใจในตลาดการเงินไทย. (พิมพ์ครั้งที่ 2) กรุงเทพฯ : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย, 2546 : 100-113.

สมหมาย ปฐมวิชัยวัฒน์ และไพบุลย์ เสรีวัฒนา, เอกสารประกอบการบรรยายวิชาการลงทุน (พิมพ์ครั้งที่ 8). สาขาวิทยาการจัดการ มหาวิทยาลัยสุโขทัยธรรมาธิราช กรุงเทพมหานคร : สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยสุโขทัยธรรมาธิราช, 2539.

สันติ กิระนันท์, ความรู้พื้นฐานการเงิน: หลักการ เหตุผล แนวคิด และการวิเคราะห์. กรุงเทพฯ : บริษัท เฟื่องฟ้า พรินติ้ง จำกัด, 2546.

สุพล ดุรงค์วัฒนา, การพยากรณ์ทางธุรกิจ. ภาควิชาสถิติ คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย กรุงเทพมหานคร : โรงพิมพ์จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2537.

อัญญา ชันธวิทย์, การอนุมานตัวแบบจำลองเพื่อกำหนดราคาสัญญาออปชั่นของดัชนี SET50. รายงานวิจัยวิชาการ กรุงเทพฯ: คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2550.

อรัญ ธรรมโน. (อ้างถึงใน มารวย ผดุงสิทธิ์ 2548) ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย อดีต ปัจจุบัน และอนาคต. กรุงเทพฯ : บริษัท อมรินทร์พรินติ้งแอนด์พับลิชชิ่ง จำกัด (มหาชน), 2547.

#### เอกสารอื่นๆ

จันทรา อร่ามเจริญ. (2540). พฤติกรรมการณ์เคลื่อนไหวของราคาหลักทรัพย์ ภาคนิพนธ์ พัฒนบริหารศาสตร์มหาบัณฑิต, สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์, คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ.

จิตวัฒนา จุงพงศ์. (2551). การพยากรณ์ค่าความผันผวนของดัชนีราคาหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย วิทยานิพนธ์บัณฑิต, มหาวิทยาลัยศิลปากร, สาขาเศรษฐศาสตร์บริหารธุรกิจและการจัดการ.

เจน ประสิทธิ์ล้ำค่า. (2526). พฤติกรรมการณ์เคลื่อนไหวของราคาหลักทรัพย์ วิทยานิพนธ์ปริญญา มหาบัณฑิต. มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, คณะเศรษฐศาสตร์.

ชำนาญ มงคลเกษม. (2522). พฤติกรรมการเคลื่อนไหวของราคาหลักทรัพย์ วิทยานิพนธ์ปริญญา  
มหาบัณฑิต. จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, บัณฑิตวิทยาลัย, แผนกวิชาเศรษฐศาสตร์.

ฐานิสต์ อานนท์กิจพานิช. (2551). การทดสอบประสิทธิภาพของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย  
วิทยานิพนธ์มหาบัณฑิต. มหาวิทยาลัยขอนแก่น, เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต, สาขา  
เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. (2542) "FACT BOOK 1998 กรุงเทพมหานคร":  
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. (2540) "ตลาดหุ้นในประเทศไทย กรุงเทพมหานคร":  
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

ธนกร ชัยชาญอุดมสุข. (2534). เทคนิคการพยากรณ์ราคาหลักทรัพย์ ภาคนิพนธ์พัฒนาการ  
เศรษฐกิจมหาบัณฑิต. สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์, คณะพัฒนาการ  
เศรษฐกิจ.

นุชนีย์ แซ่หลี่. (2534). ความรวดเร็วในการปรับตัวของราคาหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่ง  
ประเทศไทย วิทยานิพนธ์ปริญญามหาบัณฑิต. จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, บัณฑิต  
วิทยาลัย, ภาควิชาเศรษฐศาสตร์.

ปิยวดี นิยมรัฐ. (2534). การทดสอบสมมติฐานเกี่ยวกับประสิทธิภาพของตลาดหลักทรัพย์ โดย  
พิจารณาถึงพฤติกรรมของราคาหลักทรัพย์ในประเทศไทย วิทยานิพนธ์ปริญญา  
มหาบัณฑิตภาควิชาเศรษฐศาสตร์. จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, บัณฑิตวิทยาลัย.

เมธินี รัชมีวิจิตรไพศาล. (2530). ความสัมพันธ์ระหว่างปริมาณเงินกับราคาหลักทรัพย์ในประเทศ  
วิทยานิพนธ์ปริญญามหาบัณฑิต. จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, บัณฑิตวิทยาลัย,  
ภาควิชาเศรษฐศาสตร์.

ศิริพร เจริญกล้าปี. (2548). ประสิทธิภาพตลาดบิรวรรตเงินตราของประเทศไทย กรณีศึกษาเงินบาทกับเงินดอลลาร์สหรัฐฯ เงินเยนญี่ปุ่น และเงินยูโรของสหภาพยุโรป งานวิจัยเฉพาะเรื่อง เศรษฐศาสตร์มหำบัณฑิต (เศรษฐศาสตร์ธุรกิจ), มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, คณะเศรษฐศาสตร์.

### Books

Box, G.E.P. and G.M. Jenkins. Time series Analysis Forecasting and Control.  
San Francisco. CA: Holden-Day Inc, 1976.

Cochrane, D. and G.H. Orcutt. Application of Least – Squares Regressions to Relationship Containing Auto – correlated Error Terms.  
J. Amer. Stat. Assoc. 44, 1949 : 32-61.

Cooper, John C.B. World Stock Markets : Some random walk tests. Applied  
Economics. 14, 1982 : 515- 531.

Darrat, A. F. and Zhong, M. On testing the random walk hypothesis.  
a model-comparison approach. Financial Review, 35(3), 2000 : 105-124.

Dickey,D. and W.Fuller. Distribution to the Estimates for Autoregressive Time Series with Unit root. J. Amer. Stat. Assoc. 74, 1979 : 427-431.

Dtantralertpab, Panadda. Securities Exchange of Thailand Bangkok. Bangkok :  
Business Information and Research Co.,Ltd., 1978.

- Durbin, J. Testing for Serial Correlation in Least- Squares Regression When Some of the Regressors Are Lagged Dependent Variables. *Econometrica* 38, 1970 : 410-421.
- Engle, R. Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimates of the Variance of the United Kingdom Inflation. *Econometrica* 50, 1982 : 987-1008.
- Fisher, Donald E. and Jordan, Ronald J. Security Analysis And Portfolio Management. : Prentice-Hall International, Inc., USA., 1995.
- Francis, Jack Clark. Investment Analysis and Management. 3<sup>rd</sup> ed Mc Graw Hill Book Company, USA, 1980 : 59-62.
- Gujarati, D.N. Basic Econometrics. 3<sup>rd</sup> ed New York: McGraw-Hill, 1995.
- Hong, Hai, Dr. The Random Walk in Stock Markets : Theory and Evidence. *Securities Industry Review* No. 4 (April 1978) : 25-29.
- Inder, B. An Approximation to the Null Distribution of Durbin – Watson Statistic in Models Containing Lagged Dependent Variables. *Econometric Theory* 3, 1986 : 413-428.
- Johnston, J. Econometric Methods. 3<sup>rd</sup> ed New York : McGraw-Hill, 1984.
- Kiviet, J.F. On the Vigour of some Misspecification Tests for Modelling Dynamic Relationships. *Rev. Econ. Stud.* 53, 1986 : 241-262.

Pindyck, R.S, and D.L. Rubinfeld. Econometric Models and Economic Forecasts.  
4<sup>th</sup> ed New York : McGraw-Hill, 1998.

Practz, P.D. Australian Share Prices and The Random Walk Hypothesis. Share Markets  
and Portfolio Theory. Edited by Ray Ball, Phillip Brown, Frank J. Finn and  
R.R. Officer. St Lucia Queensland : University of Queensland Press, 1980 : 96.

Reilly, Frank K. Investment Analysis and Portfolio Management. Illinois : The Dryden  
Press, 1978.

Robert S. Pindyck and Daniel L. Rubinfeld. Econometric Model and Economic Forecasts.  
3<sup>rd</sup> ed : McGraw Hill International Editions, Singapore, 1991.

Theil, H. Principles of Econometrics. New York: John Wiley & Sons, 1971.

Walker, A.M. On the Periodicity in series of Related Terms. In Proceedings of Roy.Soc.  
of London,A131, 1931 : 518-32

Word, H. A study in the Analysis of stationary Time Series. Stockholm : Almqvist&Wiksell  
(1<sup>st</sup> ed.,1938), 1954.

### Articles

Bollerslev, T. "Generalized autoregressive conditional heteroscedasticity."  
Journal of Econometrics 31(3), 1986 : 307-327.

Fama, Eugene F. "The Behavior of Stock Market Price." Journal of Business 38  
(January 1965) : 34-105.

Fama, Eugene F. "Efficient Capital Market : A Review of Theory and Empirical Work."  
Journal of Finance. 25 (May 1970) : 384-387.

Seddighi, H. R. and Nian, W. "The chinese stock exchange market: operations  
and efficiency." Applied Financial Economics. 14(11), 2004 : 785-797.

Slutzky, E. "The summation of Random Causes as the Source of Cyclic Process."  
Econometrica. 5, 1937 : 105-46

#### สื่ออิเล็กทรอนิกส์

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. ค้นเมื่อ 16 มิถุนายน 2551,  
จาก <http://www.set.or.th>

สำนักข่าวแห่งชาติ. ลำดับเหตุการณ์วิกฤติเศรษฐกิจสหรัฐ. ค้นเมื่อ 2 ตุลาคม 2551,  
จาก <http://www.thainewstalk.com/?p=102>

Yu, W. W. The Behavior of stock prices on the shanghai securities exchange: implication  
for the stock market reform in China, 1996 : available at  
<http://ace.acadiau.ca/fps/busiconf/ernie/wayneyu.htm>