

บรรณานุกรม

หนังสือและบทความในหนังสือ

ฉันทลักษณ์ ฌ ป้อมเพชร , เยาวมาลย์ เมธาภิรักษ์ และศรีเพ็ญ ทรัพย์มนต์ชัย. สถิติเพื่อการวางแผน.
กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2537.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. ตลาดหุ้นในประเทศไทย พิมพ์ครั้งที่ 7. กรุงเทพฯ: 2536.

—————. เอกสารเผยแพร่ FACT BOOK ปี 1992. กรุงเทพฯ: 2535.

—————. เอกสารเผยแพร่ FACT BOOK ปี 1993. กรุงเทพฯ: 2536.

—————. เอกสารเผยแพร่ FACT BOOK ปี 1994. กรุงเทพฯ: 2537.

—————. เอกสารเผยแพร่ FACT BOOK ปี 1998. กรุงเทพฯ: 2538.

ปราการ อาภาศิลป์. “ภาวะตลาดหลักทรัพย์ในช่วงปี 2536 และแนวโน้ม.” ใน เอกสารทางวิชาการประกอบการสัมมนาทิศทางการเศรษฐกิจไทยปี 2537. รวบรวมและจัดพิมพ์โดย สมาคมเศรษฐศาสตร์ธรรมศาสตร์. กรุงเทพฯ: 2536.

—————. “ภาวะตลาดหลักทรัพย์ในช่วงปี 2537 และแนวโน้ม.” ใน เอกสารทางวิชาการประกอบการสัมมนาทิศทางการเศรษฐกิจไทยปี 2538. รวบรวมและจัดพิมพ์โดย สมาคมเศรษฐศาสตร์ธรรมศาสตร์. กรุงเทพฯ: 2537.

เพชร ชุมทรัพย์. หลักการลงทุน. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2531.

สุปราณี พิงโสมณ. ระบบการซื้อขายหุ้นด้วยคอมพิวเตอร์. กรุงเทพฯ: 2536.

เอกสารอื่นๆ

เจน ประสิทธิ์ล้ำค่า. "พฤติกรรมการณ์เคลื่อนไหวของราคาหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย." วิทยานิพนธ์
มหาบัณฑิต คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2526.

ถนอมศรี ฟองอรุณรุ่ง. "การทดสอบระดับความผันผวนของหลักทรัพย์." วิทยานิพนธ์มหาบัณฑิต
คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2537.

ปิยวดี นียมรัฐ. "การทดสอบสมมติฐานเกี่ยวกับประสิทธิภาพของตลาดหลักทรัพย์โดยพิจารณาถึง
พฤติกรรมราคาของหลักทรัพย์ในประเทศไทย." วิทยานิพนธ์มหาบัณฑิต ภาควิชา
เศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2534.

เยาวลักษณ์ วัฒนาศรีโรจน์. "ประสิทธิภาพของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย: ศึกษาเปรียบเทียบ
อัตราผลตอบแทนของธุรกิจขนาดใหญ่และธุรกิจขนาดเล็ก." วิทยานิพนธ์มหาบัณฑิต
ภาควิชาการธนาคารและการเงิน จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2530.

สถาบันวิจัย บริษัทหลักทรัพย์เอ็กซ์แอง จำกัด (มหาชน). "ตารางเหตุการณ์สำคัญ." ใน *Monthly Strategy*.
รวบรวมและจัดพิมพ์โดย สถาบันวิจัย บริษัทหลักทรัพย์เอ็กซ์แอง จำกัด (มหาชน). กรุงเทพฯ.

สเก็ดดาว ชื่อวัฒนะ. "การเสนอขายหลักทรัพย์ใหม่ในตลาดแรกต่อประชาชน : พฤติกรรมการณ์
กำหนดราคาและอัตราผลตอบแทน." วิทยานิพนธ์มหาบัณฑิต คณะเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2537.

อนุวัฒน์ จงยินดี. "ความสัมพันธ์ระหว่างการประกาศจ่ายเงินปันผลกับการเปลี่ยนแปลงของราคาหุ้นในตลาด
หลักทรัพย์แห่งประเทศไทย." วิทยานิพนธ์มหาบัณฑิต ภาควิชาการธนาคารและการเงิน
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2529.

Articles

Amihud , Y., H. Mandelson. "Trading mechanisms and stock returns : An empirical
investigation." *Journal of Finance* 42 (1987) : 536-538.

- Black , Fisher. "Noise." Journal of Finance 41 (July 1986) : 529-534.
- Damodaran, A.. 1993, "A Simple Measure of Price Adjustment Coefficients,"
Journal of Finance 48 (1993) : 387-400.
- Dann, L., D. Mayers and R. Rabb. "Trading Rules, Large Blocks And The Speed of
Price Adjustment." Journal of Financial Economics 4 (1977) : 3-22.
- Eugene F. Fama , Lawrence Fisher , Michael Jensen and Richard Roll. "The Adjustment of
Stock prices to New Information." International Economic review 10
(February 1969) : 1-21.
- Eugene F. Fama, "Efficient Capital Market : A Review of Theory and Empirical Work."
Journal of Finance 25 (May 1976) : 383.
- G. Willam Schwert. "The Adjustment of Stock Prices to Information About Inflation."
Journal of Finance 36 (March 1981) : 15-29.
- H. Nejet Seyhun. "Overreaction or Fundamentals : Some Lessons from Insiders'
Response to The Market Crash of 1987." Journal of Finance 45
(1990) : 1363-1368.
- Hillmer, S.C. and P.L. Yu. "The Market Speed of Adjustment to New formation."
Journal of Financial Economics 7 (1979) : 321-345.
- Ivan I. Lustig and philip A. Leinbach. "The Small Firm Effect." Financial Analysts Journal
39 (May - June 1993) : 46-49.
- McDonald J.G. and Fisher A.K. "New-Issue Stock Price Behavior." Journal of Finance 27
(March 1972) : 97-102.

Michael J. Brennan, Narasimham Jagadeesh and Bhaskran Swaminathan. "Investment Analysis and the Adjustment of Stock Prices to Common Information." The Review of Financial Studies vol. 6 no. 4 (winter 1993) : 799-824.

Patell, J.M. and M.A. Wolfson. "The Intraday Speed of Price Adjustment of Stock Prices to Earning and Dividend Announcement." Journal of Financial Economics 13 (1984) : 223-252.