

## รายการอ้างอิง

### ภาษาไทย

- จิราลักษณ์ สุวรรณศิริ. (2545). สภาพคล่องและอัตราผลตอบแทนของหุ้นสามัญ: การศึกษาจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์หลักสูตรวิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาการเงิน คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- วรพจน์ กิตติขจรอัสวโชติ. (2541). ความสัมพันธ์ระหว่างคุณลักษณะเฉพาะของหุ้นสามัญและอัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในหุ้นสามัญของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. โครงการวิจัยหลักสูตรวิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาการเงิน คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

### ภาษาอังกฤษ

- Amihud, Y. and Mendelson, H. (1986). Asset pricing and the bid-ask spread. Journal of Financial Economics 17: 223-249.
- Anantvalee, Tapanee. (2003). Intraday stock return pattern in the Stock Exchange of Thailand. *Special Project of Master of Science in Finance*, Faculty of Commerce and Accountancy, Chulalongkorn University.
- Bildik, Recep. (2001). Intra-day seasonalities on stock returns: Evidence from the Turkish Stock Market. Emerging Markets Review 2: 387-417.
- Bollerslev, T. (1986). Generalized autoregressive conditional heteroskedasticity. Journal of Econometrics 31: 307-327.
- Bollerslev, T. (1987). A conditionally heteroskedastic time series model for speculative prices and rates of return. Review of Economics and Statistics 69: 542-547.
- Brailsford, T. (1996). The empirical relationship between trading volume, returns and volatility. Accounting and Finance 35: 89-111.
- Brennan, M. J. and Subrahmanyam, A. (1995). Investment analysis and price formation in securities markets. Journal of Financial Economics 38: 361-382.
- Chang, R.P., Fukuda, T., Ghon Rhee, S. and Takano, M. (1993). Intraday and interday behavior of the TOPIX. Pacific-Basin Finance Journal 1: 67-95

- Cheung, Y. (1995). Intraday returns and the day-end effect: Evidence from the Hong Kong equity market. Journal of Business Finance and Accounting 22(7): 1023-1035.
- Chiradatesakunvong, Supatas. (2004). Does trading volume convey information about stock prices?: Evidence from the SET. *Thesis of Master of Science Program in Finance*, Faculty of Commerce and Accountancy, Thammasat University.
- Easley, D., M. O'Hara, and P.S. Srinivas. (1998). Option volume and stock prices: Evidence on where informed traders trade. Journal of Finance 2: 431-465.
- Engle, R. (1982). Autoregressive conditional heteroskedasticity with estimates of variance of U.K. Inflation. Econometrica 50: 987-1008.
- Engle, R. (1993). Statistical models for financial volatility. Financial Analysts Journal 49: 72-78.
- Engle, R. and Bollerslev, T. (1986). Modeling the persistence of conditional variances. Econometric Reviews 5: 1-50.
- Epps, T. and Epps, M. (1976). The stochastic dependence of security price changes and transaction volumes: Implications for the mixture of distributions hypothesis. Econometrica 44: 305-321.
- Foster, A. (1995). Volume-volatility relationships for crude oil futures markets. Journal of Futures Markets 15: 929-951.
- Harris, Lawrence E. (1986). A transaction data study of weekly and intradaily patterns in stock returns. Journal of Financial Economics 16: 99-117.
- Jain, Prem C. and Joh, G. (1988). The dependence between hourly prices and trading volume. Journal of Financial and Quantitative Analysis 33(3): 269-283.
- Karpoff, J.M. (1987). The relation between price changes and trading volume: A survey. Journal of Financial and Quantitative analysis 22: 109-123.
- Kyle, A.S. (1985). Continuous auctions and insider trading. Econometrica 53: 1315-1336.
- Lamoureux, C. and Lastrapes, W. (1990). Heteroskedasticity in stock return data: Volume versus GARCH effects. Journal of Finance 45: 221-229.

- Leemakdej, Arnat. (1998). Test of informed trader migration in emerging market: Case study of warrant introduction in Thai market. Faculty of Commerce and Accountancy Thammasat University.
- Najand, M. and Yung, K. (1991). A GARCH examination of the relationship between volume and price variability in futures markets. Journal of Futures Markets 11: 613-621.
- Rahman, Shafiqur. (2000). Intraday return volatility process: Evidence from NASDAQ stocks. Nanyang Business School, S3-01C-100 Nanyang Technological University, Singapore.
- Rogalski, Richard. (1984). New finding regarding day of the week returns over trading and non-trading periods. Journal of Finance 39: 1603-1614.
- Sangnapaboworn, Kamolnath. (2002). The relationship between volume and volatility: Evidence from the Stock Exchange of Thailand. *Independent Study of Master of Science Program in Finance*, Faculty of Commerce and Accountancy, Thammasat University.
- Stickel, Scott E. and Verrecchia, R.E. (1994). Evidence that trading volume sustains stock price change. Financial Analysts Journal 50: 57-67
- Tangkathach, Chatuporn. (1998). Day-of-the-Week effect in Stock Exchange of Thailand. *Special Project of Master of Science in Finance*, Faculty of Commerce and Accountancy, Chulalongkorn University.
- Xu, Xiaoqing Eleanor and Wu, Chunchi. (1999). The intraday relation between return volatility, transactions and volume. International Review of Economics and Finance 8: 375-397.

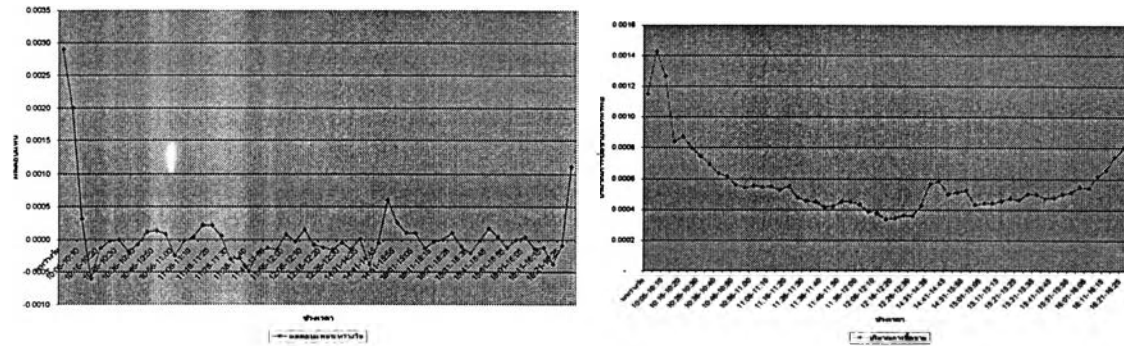
ภาคผนวก

ภาคผนวก ก.

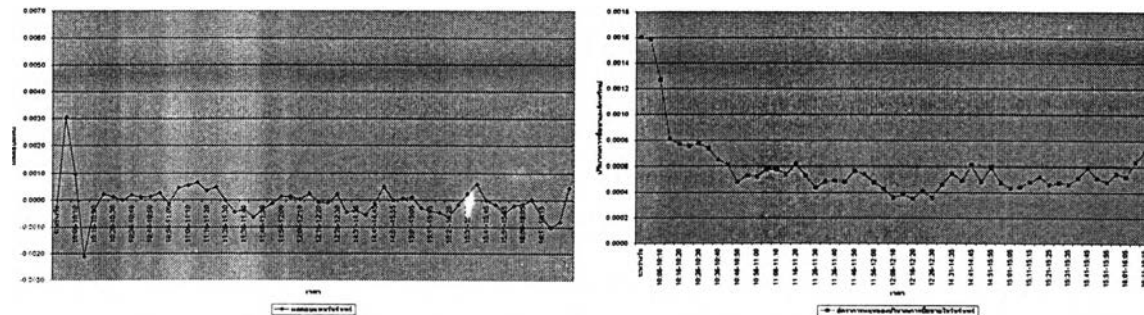
แผนภาพแสดงลักษณะผลตอบแทนและปริมาณการซื้อขายของดัชนีหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

แผนภาพแสดงลักษณะของผลตอบแทนและปริมาณซื้อขายเฉลี่ยของหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยใช้ข้อมูลราย 5 นาที ในช่วงวันที่ 1 ตุลาคม พ.ศ. 2546 ถึง วันที่ 31 มีนาคม พ.ศ. 2547

แผนภาพ ก.1: ผลตอบแทนเฉลี่ยและปริมาณการซื้อขายเฉลี่ย ในช่วงวันที่ 1 ตุลาคม พ.ศ. 2546 ถึง วันที่ 31 มีนาคม พ.ศ. 2547

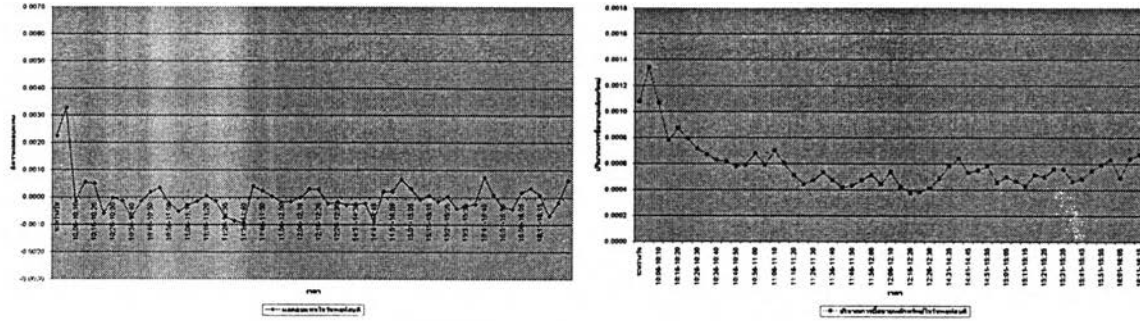


แผนภาพ ก.2: ผลตอบแทนเฉลี่ยและปริมาณการซื้อขายเฉลี่ย ในวันจันทร์

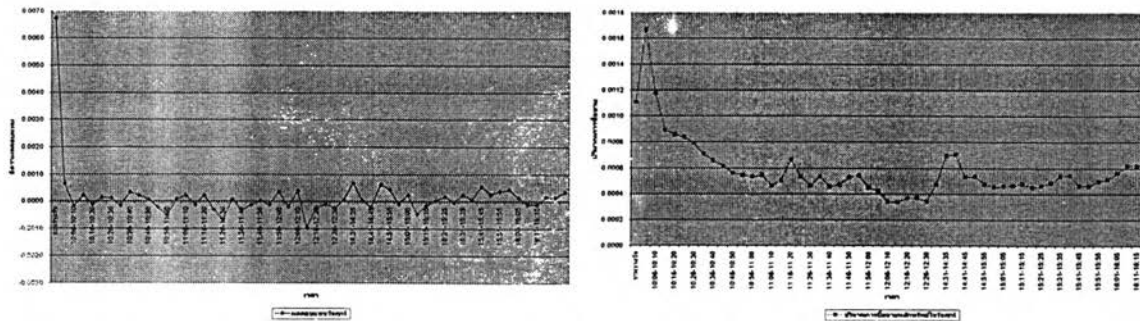




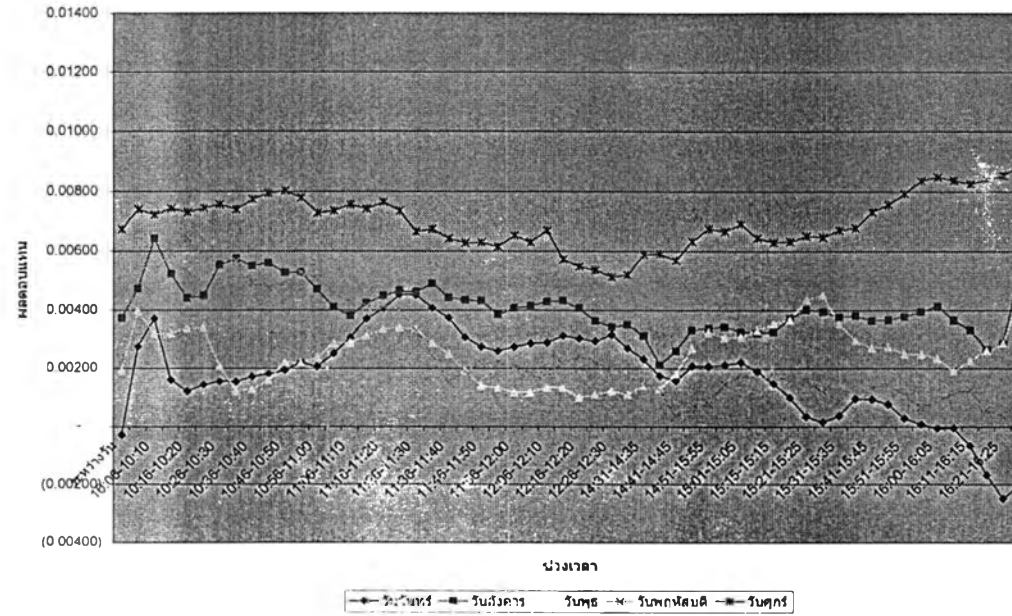
แผนภาพ ก.5: ผลตอบแทนเฉลี่ยและปริมาณการซื้อขายเฉลี่ย ในวันพฤหัสบดี



แผนภาพ ก.6: ผลตอบแทนเฉลี่ยและปริมาณการซื้อขายเฉลี่ย ในวันศุกร์



แผนภาพ ก.7: ผลตอบแทนเฉลี่ยและปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยสะสมในแต่ละวัน ในช่วงวันที่ 1 ตุลาคม พ.ศ. 2546 ถึง วันที่ 31 มีนาคม พ.ศ. 2547





## ภาคผนวก ข

ตารางแสดงรายชื่อหลักทรัพย์ที่มีปริมาณการซื้อขายมากและน้อยที่สุดในช่วงเดือน

ตุลาคม พ.ศ. 2546 ถึง มีนาคม พ.ศ. 2547

ตารางที่ ข.1: รายชื่อหลักทรัพย์ที่มีปริมาณการซื้อขายมากที่สุด ในช่วงเดือนตุลาคม พ.ศ. 2546 ถึง มีนาคม พ.ศ. 2547

อุตสาหกรรม	ตัวย่อ	บริษัท
ธนาคาร	TMB	ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน)
หลักทรัพย์	KGI	บริษัทหลักทรัพย์เกียรติก่อ จำกัด (มหาชน)
พลังงาน	SUSCO	บริษัทสยามสหบริการ จำกัด (มหาชน)
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	HEMRAJ	บริษัทเนมาอสังหาริมทรัพย์ จำกัด (มหาชน)
อื่นๆ	GENCO	บริษัทบริหารและพัฒนาการเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม จำกัด (มหาชน)
สื่อสาร	TT&T	บริษัททีทีแอนด์ที จำกัด (มหาชน)
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	BLAND	บริษัทบางกอกแลนด์ จำกัด (มหาชน)
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	SPALI	บริษัทศุภาสัย จำกัด (มหาชน)
บันเทิงและสันทนาการ	ITV	บริษัทไอทีวี จำกัด (มหาชน)
บันเทิงและสันทนาการ	DOI	บริษัทดีจิดอ ออเน้า อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน)
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	ESTAR	บริษัทอีสเทิร์น สตาร์ เรส เอสเตท จำกัด (มหาชน)
ธนาคาร	KTB	ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	KMC	บริษัทกฤษตามหานคร จำกัด (มหาชน)
ธนาคาร	BAY	ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)
เงินทุนหลักทรัพย์	NFS	บริษัทเงินทุนธนชาติ จำกัด (มหาชน)
สื่อสาร	JAS	บริษัทเจสมิน อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน)
เคมีภัณฑ์และพลาสติก	VNT	บริษัทวีบีไทย จำกัด (มหาชน)
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	NWR	บริษัทเนวาร์ตน์ พัฒนาการ จำกัด (มหาชน)
สื่อสาร	SHIN	บริษัทชินคอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	LH	บริษัทแลนด์ ลอน เฮ้าส์ จำกัด (มหาชน)
ธุรกิจเกษตร	CPF	บริษัทเจริญโภคภัณฑ์อาหาร จำกัด (มหาชน)
เงินทุนหลักทรัพย์	TNITY	บริษัททีเอ็นที วัลลภา จำกัด (มหาชน)
เงินทุนหลักทรัพย์	ASL	บริษัทหลักทรัพย์แอสเคชั่น จำกัด (มหาชน)
ธนาคาร	KBANK	ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)
ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์	KRP	บริษัทเค.อาร์.พี. จำกัด (มหาชน)
พลังงาน	BCP	บริษัทบางจากปิโตรเคมีภัณฑ์และพลาสติก จำกัด (มหาชน)
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	AP	บริษัทเอเชีย นีโพรเพอรัล ดีเวลอปเม้นท์ จำกัด (มหาชน)
ธนาคาร	BOA	ธนาคารเอเชีย จำกัด (มหาชน)
สื่อสาร	TA	บริษัทเทเลคอมเอเชีย คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)
สื่อสาร	UCOM	บริษัทยูไนเต็ดคอมมูนิเคชั่นอินดิสทรี จำกัด (มหาชน)
วัสดุก่อสร้างและตกแต่ง	TGP	บริษัทไทยผลิตภัณฑ์ซีเมนต์ จำกัด (มหาชน)
บรรจุภัณฑ์	TFI	บริษัทไทยฟิล์มอินดัสทรี จำกัด (มหาชน)
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	PF	บริษัทพร็อพเพอร์ตี้ เพอร์เฟก จำกัด (มหาชน)
วัสดุก่อสร้างและตกแต่ง	VNG	บริษัทวินชัย กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	STECON	บริษัทชิน-ไทย เอ็มจีเนอริ้ง จำกัด (มหาชน)
เงินทุนหลักทรัพย์	SICCO	บริษัทเงินทุนสินอุตสาหกรรม จำกัด (มหาชน)
เงินทุนหลักทรัพย์	ZMICO	บริษัทหลักทรัพย์ซีเอ็มไอ จำกัด (มหาชน)
วัสดุก่อสร้างและตกแต่ง	SSI	บริษัทสหวิทย์ศาสตร์คอนกรีต จำกัด (มหาชน)
พลังงาน	PTT	บริษัทปตท. จำกัด (มหาชน)
พลังงาน	LANNA	บริษัทลานนา รีซอร์สเซส จำกัด (มหาชน)
เงินทุนหลักทรัพย์	TK	บริษัททีดี จำกัด (มหาชน)
บันเทิงและสันทนาการ	TRAF	บริษัทกราฟิกคอร์ปอเรชันโฮลดิ้งส์ จำกัด (มหาชน)
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	AMATA	บริษัทอมตะ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	OH	บริษัทควอลิตี้เฮ้าส์ จำกัด (มหาชน)
เคมีภัณฑ์และพลาสติก	ATC	บริษัทอะโรแมติกส์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)
สื่อสาร	IEC	บริษัทอินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน)
ธนาคาร	BT	ธนาคารไทย จำกัด (มหาชน)
วัสดุก่อสร้างและตกแต่ง	TICON	บริษัทไทคอน อินดัสทรีล คอนเน็คชั่น จำกัด (มหาชน)
ขนส่ง	TTA	บริษัทโทรคมนาคมไทย จำกัด (มหาชน)
สื่อสาร	MFEC	บริษัท เอ็ม เอฟ อี ซี จำกัด (มหาชน)

ตารางที่ ข.2: รายชื่อหลักทรัพย์ที่มีปริมาณการซื้อขายน้อยที่สุด ในช่วงเดือนตุลาคม พ.ศ. 2546 ถึง เดือนมีนาคม พ.ศ. 2547

อุตสาหกรรม	ตัวย่อ	บริษัท
ธุรกิจเกษตร	PRG	บริษัทปทุมโรสมิล แอนด์ แกรนารี จำกัด (มหาชน)
สิงห์ เครื่องนุ่งห่มและรองเท้า	LTX	บริษัทสีกกี้เท็กซ์ จำกัด (มหาชน)
การแพทย์	M-CHAI	โรงพยาบาลสมหมาย จำกัด (มหาชน)
การพิมพ์และสิ่งพิมพ์	TONHUA	บริษัทบุญชัย คอมมิวนิเคชั่น จำกัด (มหาชน)
สิงห์ เครื่องนุ่งห่มและรองเท้า	UT	บริษัทยูเนียนอุตสาหกรรมสิงห์ จำกัด (มหาชน)
การพิมพ์และสิ่งพิมพ์	POST	บริษัทโพสต์ พับลิชชิง จำกัด (มหาชน)
สิงห์ เครื่องนุ่งห่มและรองเท้า	BATA	บริษัทรองเท้าบาตา จำกัด (มหาชน)
ประกันชีวิตและประกันภัย	SMG	บริษัทสามัคคีประกันภัย จำกัด (มหาชน)
อัญมณีและเครื่องประดับ	SAWANG	บริษัทสว่างเอ็กปอร์ต จำกัด (มหาชน)
สิงห์ เครื่องนุ่งห่มและรองเท้า	PG	บริษัทประชาอาภรณ์ จำกัด (มหาชน)
บรรจุภัณฑ์	TCOAT	บริษัทอุตสาหกรรมพลาสติก จำกัด (มหาชน)
การพิมพ์และสิ่งพิมพ์	TBSP	บริษัทไทยบริติช ซิตีวารีรี่ พรินต์ติ้ง จำกัด (มหาชน)
ประกันชีวิตและประกันภัย	BKI	บริษัทกรุงเทพประกันภัย จำกัด (มหาชน)
คลังสินค้าและโลจิสติกส์	UST	บริษัทยูไนเต็ด แลคเคอการค้า จำกัด (มหาชน)
อาหารและเครื่องดื่ม	TWFP	บริษัทไทยวาฟเฟิลโปรดักส์ จำกัด (มหาชน)
บรรจุภัณฑ์	THIP	บริษัททานตะวันอุตสาหกรรม จำกัด (มหาชน)
อาหารและเครื่องดื่ม	PR	บริษัทเพรซิเดนทีเรียโปรดักส์ จำกัด (มหาชน)
วัสดุก่อสร้างและตกแต่ง	TIW	บริษัทไทยแลนด์อินดิวสทรี จำกัด (มหาชน)
ธุรกิจการเกษตร	D-MARK	บริษัทพันธ์สุกรไทย-เดนมาร์ก จำกัด (มหาชน)
อาหารและเครื่องดื่ม	PB	บริษัทเพรซิเดนที เบเกอรี่ จำกัด (มหาชน)
การแพทย์	NTV	โรงพยาบาลนันทเวช จำกัด (มหาชน)
เวชภัณฑ์และเครื่องสำอาง	S & J	บริษัทเอส แอน เจ จำกัด (มหาชน)
ของใช้ในครัวเรือน	ROCK	บริษัทร็อกเว็ท จำกัด (มหาชน)
โรงแรมและบริการท่องเที่ยว	ROH	โรงแรมรอยัลคอตดิวา จำกัด (มหาชน)
เคมีภัณฑ์และพลาสติก	UP	บริษัทยูเนียนพลาสติก จำกัด (มหาชน)
การแพทย์	LNH	บริษัทเชียงใหม่ธุรกิจการแพทย์ จำกัด (มหาชน)
ประกันชีวิตและประกันภัย	TIC	บริษัทไทยประกันภัยต่อ จำกัด (มหาชน)
อาหารและเครื่องดื่ม	SFP	บริษัทอาหารสยาม จำกัด (มหาชน)
พาณิชย์	OCC	บริษัทโอซีซี จำกัด (มหาชน)
เครื่องใช้ไฟฟ้า	FMT	บริษัทฟูกาวา เมทล (ไทยแลนด์) จำกัด (มหาชน)
พาณิชย์	WG	บริษัทไวท์กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)
สิงห์ เครื่องนุ่งห่มและรองเท้า	TTL	บริษัทโรงงานผ้าไทย จำกัด (มหาชน)
พาณิชย์	BJC	บริษัทเบอร์รี่บูคเกอร์ จำกัด (มหาชน)
ธุรกิจการเกษตร	CHOTI	บริษัทหนองเย็นเซติวิวัฒนา จำกัด (มหาชน)
ประกันชีวิตและประกันภัย	NKI	บริษัทนวกิจประกันภัย จำกัด (มหาชน)
บริการเฉพาะกิจ	P-FCB	บริษัทประกัน แอน เอพีซี จำกัด (มหาชน)
สิงห์ เครื่องนุ่งห่มและรองเท้า	TTM	บริษัทไทยเทเรทเท็กซ์ทิลส์ จำกัด (มหาชน)
การแพทย์	AHC	โรงพยาบาลเอกชล จำกัด (มหาชน)
โรงแรมและบริการท่องเที่ยว	MANRIN	แมนดารินโฮเทล จำกัด (มหาชน)
อาหารและเครื่องดื่ม	TF	บริษัทไทยเพรซิเดนทีฟู้ดส์ จำกัด (มหาชน)
พาณิชย์	NC	บริษัทนิววีตี้ (กรุงเทพฯ) จำกัด (มหาชน)
อาหารและเครื่องดื่ม	SAUCE	บริษัทไทยเทรคผลิตภัณฑ์อาหาร จำกัด (มหาชน)
คลังสินค้าและโลจิสติกส์	SST	บริษัททรัพย์ศรีไทยคลังสินค้า จำกัด (มหาชน)
โรงแรมและบริการท่องเที่ยว	SHANG	เซี่ยงกรี-ลา โฮเทล จำกัด (มหาชน)
การพิมพ์และสิ่งพิมพ์	MATI	บริษัทมติชน จำกัด (มหาชน)
สิงห์ เครื่องนุ่งห่มและรองเท้า	HTX	บริษัทนครหลวงเส้นใย จำกัด (มหาชน)
ประกันชีวิตและประกันภัย	NSI	บริษัทนำสินประกันภัย จำกัด (มหาชน)
อาหารและเครื่องดื่ม	F&D	บริษัทฟู้ดแอนด์ดริงส์ จำกัด (มหาชน)
บรรจุภัณฑ์	VARO	บริษัทวโรภัณฑ์ จำกัด (มหาชน)
ของใช้ในครัวเรือน	SUN	บริษัทซันวิดิอินสตรูมেন্ট จำกัด (มหาชน)

## ภาคผนวก ค

การทดสอบ Stationary ของข้อมูลระหว่างวันราย 5 นาที โดยใช้ค่า ADF

ตารางที่ ค.1: ตารางแสดงการทดสอบ Stationary ของข้อมูลระหว่างวันราย 5 นาที

	ข้อมูลระหว่างวันราย 5 นาที	
	ผลตอบแทน	ปริมาณการซื้อขาย
ดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย	-29.6834	-19.3988
หลักทรัพย์ที่มีสภาพคล่อง	-39.8776	-27.3228
หลักทรัพย์ที่ไม่มีสภาพคล่อง	-40.4848	-30.2086
อุตสาหกรรมธุรกิจเกษตร	-38.1956	-24.7426
อุตสาหกรรมธนาคาร	-39.2940	-15.8356
อุตสาหกรรมวัสดุก่อสร้างและตกแต่ง	-20.1800	-13.0388
อุตสาหกรรมเคมีภัณฑ์และพลาสติก	-19.0619	-14.6353
อุตสาหกรรมพาณิชย์	-18.8615	-15.4233
อุตสาหกรรมสื่อสาร	-39.2498	-19.3000
อุตสาหกรรมเครื่องใช้ไฟฟ้า	-21.6900	-11.5814
อุตสาหกรรมชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์	-21.4240	-17.0294
อุตสาหกรรมพลังงาน	-36.1671	-15.0991
อุตสาหกรรมบันเทิงและสันทนาการ	-37.1359	-22.3023
อุตสาหกรรมเงินทุนหลักทรัพย์	-20.6158	-11.6882
อุตสาหกรรมอาหารและเครื่องดื่ม	-20.2150	-14.0026
อุตสาหกรรมการแพทย์	-21.1659	-15.0520
อุตสาหกรรมโรงแรมและท่องเที่ยว	-20.0132	-14.0084
อุตสาหกรรมของใช้ในครัวเรือน	-32.8624	-12.6297
อุตสาหกรรมประกันชีวิตและประกันภัย	-20.3417	-10.4554
อุตสาหกรรมเหมืองแร่	-20.6487	-13.2722
อุตสาหกรรมอื่นๆ	-20.6774	-13.0959
อุตสาหกรรมบรรจุภัณฑ์	-19.9173	-12.1430
อุตสาหกรรมเวชภัณฑ์และเครื่องประดับ	-20.1611	-21.2730
อุตสาหกรรมการพิมพ์และสิ่งพิมพ์	-18.2731	-12.4229
อุตสาหกรรมพัฒนาอสังหาริมทรัพย์	-37.1885	-19.7404
อุตสาหกรรมเยื่อกระดาษและกระดาษ	-20.7668	-11.8812
อุตสาหกรรมสิ่งทอ เครื่องนุ่งห่มและรองเท้า	-20.7355	-15.1388
อุตสาหกรรมขนส่ง	-18.8615	-15.4234
อุตสาหกรรมยานพาหนะและอุปกรณ์	-21.1226	-13.3388
อุตสาหกรรมคลังสินค้าและโซโล	-19.8610	-13.1456
อุตสาหกรรมเครื่องจักร	-20.4636	-18.3584
อุตสาหกรรมบริการ	-21.0126	-15.0099

ข้อมูลระหว่างวัน จำนวน 6,750 จำนวน

1% Critical Value*	-3.4345
5% Critical Value	-2.8625
10% Critical Value	-2.5673



## ประวัติผู้เขียนวิทยานิพนธ์

นายอนุสรณ์ พฤษาระยัพ เกิดวันที่ 15 เมษายน พ.ศ. 2523 จังหวัดชลบุรี สำเร็จการศึกษา  
ระดับมัธยมศึกษาจากโรงเรียนมหาชิรวุฒ จังหวัดสงขลา ในปี พ.ศ. 2540 สำเร็จการศึกษาระดับ  
ปริญญาตรีบริหารธุรกิจ สาขาการเงิน จากคณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี  
มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ ในปี พ.ศ. 2544 และเข้าศึกษาต่อในหลักสูตรวิทยาศาสตรมหาบัณฑิต  
สาขาวิชาการเงิน คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัยใน พ.ศ. 2545