

เอกสารอ้างอิง

- ขวัญหล้า จันทะพันธ์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- จิตราพรรณ ใจด้อย. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2544.
- เดชวิทย์ นิลวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มในกลุ่มสื่อสารตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. ฝ่ายสิ่งพิมพ์. 2547. บริษัทจดทะเบียนประกาศกำไรและปันผลหุ้น 2546. แหล่งที่มา: http://www.set.or.th/download/journal/text_mar04.pdf. 5 เมษายน 2547.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2547. Company Highligh. แหล่งที่มา: http://www2.set.or.th/set/en/company/company_u4.jsp.
- บริษัทหลักทรัพย์ เอบีเอ็น แอมโร จำกัด(มหาชน). 2547. Company Information.
- พยชน์ หาญผดุงกิจ. อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2532.
- พรชัย จิรวินิจนันท์. การประยุกต์ใช้ทฤษฎี CAPM กับหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. กรุงเทพฯ: ภาคนิพนธ์คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์, 2535.
- เพชรী ชุมทรัพย์. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 9. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2538.
- ไพฑูรย์ ไกรพรรคักดี. 2546. เศรษฐมิติเบื้องต้น. พิมพ์ครั้งที่ 2. กรุงเทพฯ: คณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

- ธนาคารแห่งประเทศไทย. อัตราดอกเบี้ยเงินฝากเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของธนาคารพาณิชย์
ระหว่าง ปี 2542-2546. ธนาคารแห่งประเทศไทย. แหล่งที่มา: http://www.bot.or.th/bothomepage/databank/Financial_Institutions/Interest_Rate/wAvgIntRates.html. 19 มีนาคม 2547.
- ธนาคารกรุงไทย จำกัด(มหาชน). 2547. ประวัติธนาคาร. แหล่งที่มา: http://www.ktb.co.th/thai/index_about.html. 20 สิงหาคม 2547.
- ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด(มหาชน). 2547. ประวัติธนาคาร. แหล่งที่มา: <http://www.krungsri.com/60/61.htm>. 20 สิงหาคม 2547.
- ธนาคารกสิกรไทย จำกัด(มหาชน). 2547. ประวัติธนาคาร. แหล่งที่มา: http://www.kasikornbank.com/Staticpage/0,1101,TFBinBrief_EN-TH-6,00.html. 20 สิงหาคม 2547.
- ธนาคารทหารไทย จำกัด(มหาชน). 2547. ประวัติธนาคาร. แหล่งที่มา: http://www.tmb.co.th/about_us.html. 20 สิงหาคม 2547.
- ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด(มหาชน). 2547. ประวัติธนาคาร. แหล่งที่มา: http://www.scb.co.th/th/th_main_about_legend.shtml. 20 สิงหาคม 2547.
- ธนาคารเอเชีย จำกัด(มหาชน). 2547. ประวัติธนาคาร. แหล่งที่มา: http://www.bankasia4u.com/about-us/bank-asia-history_th.htm. 20 สิงหาคม 2547.
- "สภาพคล่องล้มระบบจากตลาดเงินเข้าตลาดหุ้นส่งสัญญาณอัตราดอกเบี้ยสู่ภาวะขาขึ้น." 2547.
การเงินการธนาคาร 23, 262(กุมภาพันธ์): 232-234.
- สุโจจน์ ศรีแก้ว. การวิเคราะห์หุ้นกลุ่มธนาคารและกลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2535.
- สรุปข้อมูลสนเทศบริษัทจดทะเบียน 2546. 2547. กรุงเทพฯ: บริษัทนิวส์ อินเทอร์เน็ต พับลิชชิง จำกัด.
หทัยรัตน์ บุญญา. การประมาณค่าเบต้าในแบบจำลองการกำหนดราคาสินทรัพย์ประเภททุน.
การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2541.
- Data stream. 2004. Data Stream Advance 3.5. Available: Finance Investment Center,
Chiang Mai University. 15 August 004.
- Enders, W. Applied Economic Time Services. New York: Iowa State University, 1995.
- Fama, Eugene F. and French, K. R. "Common Risk Factors in the Returns on
Stocks and Bond." Journal of Financial Economics 33 (February 1993): 3-15.
- _____. Fama and French Three Factor Model. Available: <http://www.moneychimp.com/articles/risk/multifactor.htm>. 15 March 2004.

- Gregory, Connor. and Sanjay, Sehgal. 2001. **Test of the Fama and French Model in India.** Available: [http://www.lse.ac.uk/collections/Accounting And Finance/ staff/connor/files/Fama&FrenchIndia.PDF](http://www.lse.ac.uk/collections/AccountingAndFinance/staff/connor/files/Fama&FrenchIndia.PDF). 15 March 2004.
- Lintner, John. "The Valuation of Risk Asset and The Selection of Risky Investment in Stock Portfolios and Capital Budgets." **Review of Economics and Statistics** 47,1 (February 1965): 13-37.
- Markowitz, Harry. "Portfolio Selection." **Journal of Finance** (March 1952): 77-91.
- Mossin, Jan. "Equilibrium in a Capital Asset Market." **Econometrica** 34,4 (October 1966): 768-783.
- Petkova, W.F.A. 2003. **Do The Fama – French Factor Proxy for Innovations in Predictive Variable.** Available: https://wpweb2k.gsia.cmu.edu/wfa/wfasecure/upload/268727_Petkova_WFA_2004.pdf. 15 March 2004.
- Reuters. 2003. **Reuters Koobra 3.5.1.** Available: Finance Investment Center, Chiang Mai University. 15 March 2004.
- Sharpe, William F. "Capital Asset Prices: A Theory of Market Equilibrium Under Condition of Risk." **Journal of Finance** 19, 3 (September 1964): 452–422.
- _____. "Mutual Fund Performance." **Journal of Business** 39, 1 (January 1966): 199 – 138.
- _____. "A Simplified Model for Portfolio Analysis." **Management Science** (January 1963): 277-293.