

เอกสารอ้างอิง

- ขวัญหล้า จันทะพันธ์. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่ม
สื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหา
บัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2540. การลงทุน. กรุงเทพฯ : มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 1999. **Fact Book 1999**. กรุงเทพฯ : สถาบันพัฒนาบุคลากร
ธุรกิจหลักทรัพย์.
- _____. 2000. **Fact Book 2000**. กรุงเทพฯ : สถาบันพัฒนาบุคลากรธุรกิจหลักทรัพย์.
- _____. 2001. **Fact Book 2001**. กรุงเทพฯ : สถาบันพัฒนาบุคลากรธุรกิจหลักทรัพย์.
- _____. 2002. **Fact Book 2002**. กรุงเทพฯ : สถาบันพัฒนาบุคลากรธุรกิจหลักทรัพย์.
- _____. 2003. **Fact Book 2003**. กรุงเทพฯ : สถาบันพัฒนาบุคลากรธุรกิจหลักทรัพย์.
- _____. 2004. **Fact Book 2004**. กรุงเทพฯ : สถาบันพัฒนาบุคลากรธุรกิจหลักทรัพย์.
- _____. 2546. **หลักสูตรความรู้พื้นฐานเกี่ยวกับตลาดเงินและตลาดทุน**. กรุงเทพฯ : สุขุมวิท มีเดีย.
- เถลิงศักดิ์ นุชประหาร. 2542. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อการกำหนดอัตราแลกเปลี่ยนเงิน
ตราต่างประเทศ. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2543. **เศรษฐมิติเบื้องต้น**. เชียงใหม่ : คณะเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัย
เชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์และอารีย์ วิบูลพงศ์. 2543. **การประยุกต์เศรษฐมิติสำหรับเศรษฐศาสตร์
เกษตร**. เชียงใหม่ : คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศิริ แต่สมบัติ. 2541. **การวิเคราะห์การถดถอย**. กรุงเทพฯ : คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัย
เกษตรศาสตร์
- ธนิดา กาญจนพันธุ์. 2535. **ผลกระทบของปัจจัยทางเศรษฐกิจต่อราคารัฐหุ้นของไทย**. วิทยานิพนธ์
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- บุญศรี ตริหิรัญกุล. 2539. **ปัจจัยที่มีผลกระทบต่ออัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในหลักทรัพย์**.
การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ไพฑูรย์ ไกรพรศักดิ์. 2546. **เศรษฐมิติเบื้องต้น**. กรุงเทพฯ : คณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์
มหาวิทยาลัย.

- รุ่งระวี สิทธิกร. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในชนส่งในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีการโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เริงชัย ต้นสุชาติ. 2546. เศรษฐมิตติ. เชียงใหม่ : คณะธุรกิจการเกษตร มหาวิทยาลัยแม่โจ้.
- ศิริชัย พงษ์วิชัย. 2543. การวิเคราะห์ข้อมูลทางสถิติด้วยคอมพิวเตอร์. กรุงเทพฯ : คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- สรุปข้อสนเทศ บริษัทจดทะเบียน 2547 เล่ม 1. 2547. กรุงเทพฯ : นิวส์ อินเตอร์เน็ต พับลิชชิ่ง จำกัด.
- สุนทรา สุกันธา. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ธุรกิจเกษตรในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีการโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์. 2547. แบบแสดงรายการข้อมูลประจำปี (แบบ 56-1). แหล่งที่มา : <http://www.set.or.th/set/companyinfo.do>. 12 มกราคม 2547
- อุมาภรณ์ เจริญพัฒนา. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุก่อสร้างและตกแต่งในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Bartholdy, Jan and Peare, Paula. 2003. **Estimation of Expected Return: CAPM vs Fama and French.** Aarhus, Den : Department of Economics University of Aarhus. Available: <http://www.cls.dk/caf/wp/wp-176.pdf> 10 October 2004.
- Carter, Hill R; Griffiths, William E. and Judge, George G. 2001. **Undergraduate Econometrics.** 2nd ed. Now York : John Wiley.
- Damodar N. Gujarati. 2003. **Basic Econometrics.** 4th ed. Now York : McGraw-Hill.
- Fama, E.F. and French, K.R. 1992. "The Cross-section of Expected Stock Return". **Journal of Finance** 47: 427-465
- Faff, Robert W. "An Estimation of the Fama and French Three-Factor Model Using Commercially Available Factors." **Australian Journal of Management** 26, 1 (June 2001) :1-18.
- Fischer, Donald E. and Jordan, Ronald J. 1995. **Security Analysis and Portfolio Management.** 6th ed. Englewood Cliffs, NJ: Prentice – Hall.

- Goncalves, Manuel; Garay, Urbi and Gonzalez, Maximiliano. 2002. **Fama and French Factors and Stock Returns in Venezuela.** Instituto de Estudios Superiores de Administracion. Available : <http://207.36.165.114/Denver/Papers/Fama%20and%20Factors%20-%20Venezuela.pdf> 10 October 2004.
- Gregory, Connor and Sehgal, Danjay. 2001. **Tests of the Fama and French Model in India.** Dehli:University of Dehli. Available:[http://www.lse.ac.uk/colections /accounting and finance/staff/connor/files/Fama&FrenchIndia.PDF](http://www.lse.ac.uk/colections/accounting%20and%20finance/staff/connor/files/Fama&FrenchIndia.PDF) 10 October 2004.
- Johnston, J. and Dinardo, J. 1997. **Econometric Methods.** 4th ed. New York: McGraw – Hill.
- Markowitz, Harry. “Portfolio Selection.” **Journal of Finance** (March 1952): 77 – 91.
- Mossion, Jan. “Equilibrium in a Capital Asset Market.” **Econometrica** 34, 4 (October 1966) : 768 – 784.
- Reuters. 2004. **Reuters Kobra 3.5.1.** Available: Finance Investment Center, Chiangmai University. 8 November 2004.
- Sharpe, William F. “Capital Asset Prices: A Theory of Market Equilibrium Uner Conditions of Risk”. **Journal of Finance** 19, 3 (September 1964) : 425 – 442.