

เอกสารอ้างอิง

- กรมส่งเสริมการค้าระหว่างประเทศ กระทรวงพาณิชย์. ข้อมูลการค้าและการส่งออก. แหล่งที่มา: <http://www.depthai.go.th>. 10 พฤษภาคม 2548.
- ขวัญหล้า จันทะพันธ์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์. รายงานตลาดทุนรายไตรมาส. แหล่งที่มา: <http://www.sec.or.th>. 24 พฤศจิกายน 2547.
- จิราวัลย์ ภูแสงสัน. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- จิตราพรรณ ใจตุ้ย. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์ของกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2544.
- ทมาภรณ์ กองแก้ว. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้วิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. เอกสารประกอบการสอนวิชาเศรษฐมิติ. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2545.
- ทรงศิริ แต่สมบัติ. เทคนิคการพยากรณ์เชิงปริมาณ. กรุงเทพฯ: ฟิสิกส์เซ็นเตอร์.
- บริษัท เซ็ทเทรด ดอท คอม จำกัด. ความรู้การลงทุน. แหล่งที่มา: <http://www.settrade.com>. 20 พฤศจิกายน 2547.
- เพชร ชุมทรัพย์. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 9. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2538.

ภัศรา ศรีวรกุล. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มบັນเทิงและสันทนา การด้วยวิธีการเส้นพรมแดนเชิงเฟ้นสุ่ม. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547.

วชิรภูมิ เบญจวัฒนวงศ์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

วิสุมิตรา วงศ์เลี้ยงถาวร. การวิเคราะห์ ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยใช้วิธีโคอินทีเกรชั่น และเอเรอร์คอร์เรคชั่น . การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย สถาบันพัฒนาบุคลากรธุรกิจหลักทรัพย์. เงินทองต้องใส่ใจ. กรุงเทพฯ: สถาบันพัฒนาบุคลากรธุรกิจหลักทรัพย์, 2546

อนุพัฒน์ สิทธิโชคชัยวุฒิ. การวิเคราะห์การลงทุนของหุ้นบางกลุ่มในกลุ่มเครื่องใช้ไฟฟ้าและคอมพิวเตอร์ โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.

อรวรรณ โพธิบุตร. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ด้วยวิธีการเส้นพรมแดนเชิงเฟ้นสุ่ม. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547.

Fama, Eugene F. and French, Kenneth R. "Common Risk Factors in the Returns on Stocks and Bonds". **Journal of Financial Economics** 33 (February 1993): 3-56.

"Fama and French Three Factor Model". Available: <http://www.moneychimp.com/articles/risk/multifactor.htm>. January 18, 2005.

Reuters. 2005. **Reuter Kobra 3.5.1**. Available: Finance Investment Center, Chiangmai University. March 8, 2005.