

บรรณานุกรม

- จิรัตน์ สังข์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2544.
- จิราวัลย์ ภูแสงสัน. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์
ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2543.
- ชัยโย กรกิจสุวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มพลัง
งานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหา
บัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- เดชวิทย์ นิลวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มสื่อสารใน
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. เอกสารประกอบการสอนวิชาเศรษฐมิติ. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2545. (อัดสำเนา)
- รวิชัย งามสันติวงศ์. SPSS FOR WINDOWS หลักการและวิธีใช้คอมพิวเตอร์ในงานสถิติเพื่อ
การวิจัย. พิมพ์ปรับปรุงครั้งที่ 4. กรุงเทพฯ: ซีเอ็ดดูเคชั่น, 2543.
- นภเกตน์ เอี่ยมเพชรพงศ์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงอัตราผลตอบแทนและการเลือกลงทุนใน
หลักทรัพย์กลุ่มสื่อสารโดยใช้แบบจำลอง CAPM: แบบฝึกหัดการวิจัย วิชา 751409.
เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2543.
- บริษัทหลักทรัพย์ เอกธำรง เคจีไอ จำกัด (มหาชน). 2546. Bisnews. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา:
<http://www.kgi.co.th>. 13 มีนาคม 2546.
- พยชน์ หาญผดุงกิจ. อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2532.
- พรชัย จิรวินิจนันท์. การประยุกต์ใช้ทฤษฎี CAPM กับหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ในตลาด
หลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. กรุงเทพฯ: ภาคนิพนธ์คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ
สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์, 2535.

พรรณณี อิศรพงศ์ไพศาล. การเลือกลงทุนซื้อหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2520.

พิบูล แซ่โล้ว. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์กลุ่มขึ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ในตลาดหลัก

ทรัพย์ แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัย
เชียงใหม่, 2544.

พิเชษฐ์ พรหมสุข. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อค่าพรีเมียมและค่าชดเชยความเสี่ยงในการซื้อ

ขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัย
เชียงใหม่, 2540.

เพชร ชุมทรัพย์. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 9. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์,
2538.

ยุทธนา เรือนสุภา. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ใน

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2543.

เยาวลักษณ์ อรุณมีศรี. การลงทุนในหลักทรัพย์ของชาวต่างประเทศในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัย
เกษตรศาสตร์, 2534.

สุโลจน์ ศรีเกล้า. ปัจจัยที่มีความสัมพันธ์ต่อดัชนีราคาหุ้นในตลาดหุ้น. วิทยานิพนธ์

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2535.

หทัยรัตน์ บุญโญ. การประมาณค่าเบต้าในแบบจำลองการกำหนดราคาสินทรัพย์ประเภททุน. วิทยา

นิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2541.

Bassett, Gilbert W. and Hsiu-Lung Chen. "Portfolio Style: Return-based Attribution Using
Quantile Regression." *Empirical Economics* 26 (2001): 293-305.

Berk, Jonathan B. "A Critique of Size-Related Anomalies." *The Review of Financial Studies*
8 (1995): 275-286.

Enders, W. *Applied Economic Time Services*. New York : Iowa State University, 1995.

Fama, Eugene F. and French, R. French. "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*. [Online]. Available:

<http://www.moneychimp.com/articles/risk/multifactor.htm>. 11 January 2003.

- Lintner, John. "The Valuation of Risk Asset and the Selection of Risky Investments in Stock Portfolios and Capital Budgets." **Review of Economics and Statistics** 47, 1 (February 1965): 13 - 37.
- _____. "Security Prices, Risk and Maximal Gains from Diversification." **Journal of Finance** (December 1965): 587 – 615.
- 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.
- Reuters. 2003. **Reuters Kobra 3.5.1**. [Online]. Available: Finance Investment Center, Chiang Mai University. 11 January 2003.
- Sharpe, William F. "Capital Asset Prices : A Theory of Market Equilibrium Under Conditions of Risk." **Journal of Finance** 19, 3 (September 1964): 425 – 442.
- _____. "Mutual Fund Performance." **Journal of Business** 39, 1 (January 1966): 119 – 138.
- _____. "A Simplified Model for Portfolio Analysis." **Management Science** (January 1963): 277 – 293.