

บรรณานุกรม

- ขวัญฤทัย วชิรพันธ์สถิต. 2550. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มดัชนี SET50 ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้แบบจำลองสามปัจจัย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จักรพงษ์ เกื้อวงศ์. 2553. การใช้แบบจำลองราคาสีปัจจัยเพื่อทดสอบประสิทธิภาพของกลุ่มหลักทรัพย์ที่จัดตามอัตราการเติบโตของกำไรต่อหุ้นและอัตราส่วนราคาต่อกำไรในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2556. “ราคาดัชนีตลาดหลักทรัพย์” [ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา: <http://marketdata.set.or.th/mkt/marketsummary.do>. (19 กุมภาพันธ์ 2556).
- วิชา มิตรานันท์. 2549. การประเมินประสิทธิภาพของกลุ่มหลักทรัพย์ที่สร้างโดยอาศัยปัจจัยพื้นฐาน. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สรายุทธ หินยศ. 2554. การใช้แบบจำลองราคาสีปัจจัยเพื่อทดสอบประสิทธิภาพของกลุ่มหลักทรัพย์จัดตามลักษณะเฉพาะของหุ้นในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Carhart, Mark M. 1997. “On Persistence in Mutual Fund Performance.” **The Journal of Finance**, 52, 1: 57-82.
- Fama, Eugene F. and French, Kenneth R. 1993. “Common Risk Factors in the Return on stock and Bond.” **The Journal of Financial Economics** 33: 427-465.
- Henriksson, D., and Robert, C. Merton. 1981. “On market timing and investment performance II: statistical procedures for evaluating forecasting skills.” **Journal of Business** 54: 513-533
- Jegadeesh, Narasimham and Sheridan Titman. 1993. “Returns to Buying Winners and Selling Loser: Implications for Stocks Market Efficiency,” **Journal of Finance**, 48: 65-91.
- Jensen, Micheal C. 1967. “The Performance of Mutual Fund in the Period 1945-1964.” **The Journal of Finance**, 23: 389-416.
- Lintner, John. 1965. “The Valuation of Risk Asset and the Selection of Risky Investment in Stock Portfolios and Capital Budget.” **The review of Economics and Statistics**, 47, 1: 13-37.

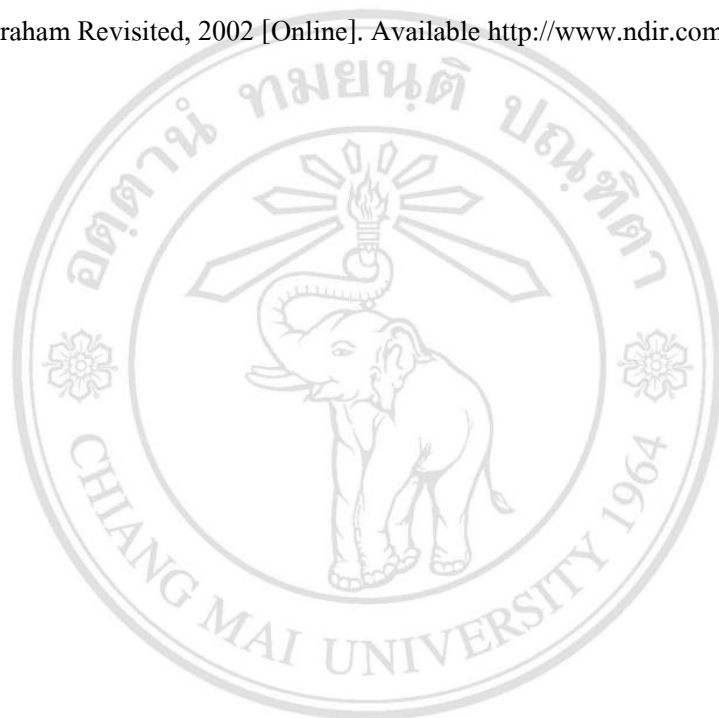
Markowitz, Harry M. 1952. "Portfolio Selection." **The Journal of Finance**, Vol.7, No.1: 77-91.

Mossin, Jan. 1966. "**Equilibrium in a Capital Asset Market.**" *Econometrical*, 34, 4: 768-783.

Sharpe, William F. 1964. "Capital Asset Prices: A Theory of Market Equilibrium under Conditions of Risk." **The Journal of Finance**, 19: 425-442.

Sharpe, William F. "**Investment 4th ed.**" New Jersey: Prentice-Hall International Inc., 1990, Page No. 720-726.

Stingy Investor. Graham Revisited, 2002 [Online]. Available <http://www.ndir.com> (19 February 2013).



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved