

เอกสารอ้างอิง

- กมล สักกะโต. 2547. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มขนส่งด้วยวิธีการเส้นพรมแดนเชิงเส้นคู่. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ขวัญหล้า จันทะพันธ์. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2547. การวิเคราะห์หลักทรัพย์โดยใช้ปัจจัยพื้นฐาน. พิมพ์ครั้งที่ 7. กรุงเทพฯ : ฝ่ายสื่อสิ่งพิมพ์ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- บริษัท เซ็ทเทรด ดอท คอม จำกัด. 2548. ภาพรวมบริษัท. แหล่งที่มา <http://www.settrade.com>. 19 กุมภาพันธ์ 2548.
- ปาริฉัตร รัตนพัวพันธ์. 2547. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม:กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงาน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปาริชาติ โภชนจันทร์. 2547. การวิเคราะห์การลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ตามทฤษฎีการกำหนดราคาแบบเอพีทีโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- พรทิพย์ เขียรธีรวิทย์. 2547. เอกสารประกอบการสอนวิชาการเงินการธนาคาร. เชียงใหม่ : คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เพชร ชุมทรัพย์. 2540. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 11. กรุงเทพฯ : มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- วิภาวี อุบลฉาย. 2546. ปัจจัยทางเศรษฐศาสตร์มหภาคที่มีอิทธิพลต่อดัชนีกลุ่ม 50 หลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- รุ่งระวี สิทธิกร. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ขนส่งในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชันของโจแฮนเซน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2545. เอกสารประกอบการสอนวิชาเศรษฐมิติ. เชียงใหม่ : คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศิริ แต่สมบัติ. 2539. เทคนิคการพยากรณ์เชิงปริมาณ. พิมพ์ครั้งที่ 1. กรุงเทพฯ : พิสิกส์เซ็นเตอร์.
- สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์. 2548. แบบรายงาน 56-1. แหล่งที่มา http://capital.sec.or.th/webapp/corp_fin/cgi-bin/find56.php. 25 มีนาคม 2548.
- สำนักงานคณะกรรมการพัฒนาเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ. 2547. GDP ไตรมาส Q4/47. แหล่งที่มา <http://www.nesdb.go.th> .17 มีนาคม 2548.
- สำนักงานนโยบายและแผนพลังงานกระทรวงพลังงาน. 2547. ราคาน้ำมัน. แหล่งที่มา <http://www.eppo.go.th>. 14 มกราคม 2548.
- สุนทรา สุกันธา. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ธุรกิจเกษตรในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีการโคอินทริเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สุพิมพ์พรรณ พู่เจริญ. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุก่อสร้างและตกแต่งโดยวิธีการถดถอยแบบสลับสับเปลี่ยน. การค้นคว้าอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อัญญา ชันชวิทย์. 2547. การวิเคราะห์ความเสี่ยงจากการลงทุนในหลักทรัพย์. กรุงเทพฯ : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- Bartholdy, J. and Peare, P. 2004. **Estimation of Expected Return : CAPM vs Fama and French**. University of Aarhus.
- Fama, E. and French, R. 1993. "Common Risk Factors in the Returns on Stocks and Bonds" **Journal of Financial Economics** 33 : 3-56.
- Fama, E., and MacBeth, J. 1973. "Risk, Return, and Equilibrium : Empirical Test" **Journal of Political Economy** 71 : 607-635.
- Reuter. 2004. **Reuters Kobra 3.5.1**. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 26 December 2004.
- Sharpe, William F., Alexander, Gordon J. and Bailey, Jeffery V. 1995. **Investment**. Englewood Cliffs, N J : Prentice Hall.