

เอกสารอ้างอิง

- ขวัญหล้า จันทะพันธ์. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อ
สารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จริญญา บาลสุข. 2547. การทดสอบแบบจำลองฟาร์มาและเฟรนนซ์กับหลักทรัพย์ธนาคารพาณิชย์
ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิตรพรพรรณ ใจตุ้ย. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์ของกลุ่มพลังงาน
ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิราวัลย์ ภูแสงสัน. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มเงินทุนหลัก
ทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหา
บัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เฉลิมพงษ์ คงเจริญ. 2546. การใช้โปรแกรม Eview: เอกสารประกอบการสอน. กรุงเทพฯ: คณะ
เศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2549. ข้อมูลสถิติการซื้อขายหลักทรัพย์ปี 2548 (Fact book
2005). พิมพ์ครั้งที่ 1. กรุงเทพฯ: บริษัท บุญศิริการพิมพ์ จำกัด.
- _____. 2550. ข้อมูลสถิติการซื้อขายหลักทรัพย์ปี 2549 (Fact book 2006). พิมพ์ครั้งที่ 1.
กรุงเทพฯ: บริษัท บุญศิริการพิมพ์ จำกัด.
- _____. 2550. รายงานการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. แหล่งที่มา:
<http://www.setsmart.com>. (12 กรกฎาคม 2550).
- _____. 2550. รายงานการมูลค่าตลาดรวมของธุรกิจการเงินในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
แหล่งที่มา: <http://www.setsmart.com>. (12 กรกฎาคม 2550).

_____. 2550. รายงานหลักทรัพย์ในกลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th>. (10 กรกฎาคม 2550).

ทมาภรณ์ กองแก้ว. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยใช้วิธีโครอนิเกรชั่น. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2545. เศรษฐมิตติ: เอกสารประกอบการสอน. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์. มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2550. ข้อมูลอัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 3 เดือน. แหล่งที่มา: <http://www.bot.cor.th>. (14 สิงหาคม 2550).

พนิดา กัณทาทรัพย์. 2549. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลกระทบต่อผลตอบแทนของหลักทรัพย์ที่แตกพาร์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยการทดสอบแบบจำลองฟาร์มาและเฟรนช์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

เพชร ชุมทรัพย์. 2539. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 9. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

ภัศรา ศรีวรกุล. 2547. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มบับันเทิงและสันตนาการด้วยวิธีการเส้นพรมแดนเชิงเส้น. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

มหาวิทยาลัยนิด้า. คณะเศรษฐศาสตร์. 2550. คู่มือการใช้ Eview. แหล่งที่มา: http://www.nidambe11.net/ekonomiz/eview_doc/eview_manual2.htm. (14 กันยายน 2550).

รินทิพย์ จันทรันวล. 2548. การประมาณค่าผลตอบแทนที่คาดหวังของหุ้นกลุ่มขนส่งในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยใช้แบบจำลองฟาร์มาและเฟรนช์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

วชิรภูมิ เบญจวัฒนวงศ์. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ โดยใช้วิธีการถดถอยแบบสลับสับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

วิสุมิตรา วงศ์เตียงถาวร. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มพัฒนา
อสังหาริมทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้แบบจำลอง Capital Asset
Pricing model (CAPM). การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัย
เชียงใหม่.

ศุภชัย ศรีสุชาติ. 2547. ตลาดหุ้นในประเทศไทย. กรุงเทพฯ: บริษัท บุญศิริการพิมพ์ จำกัด.

อรรพรรณ โพธิบุตร. 2547. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคาร
พาณิชย์ขนาดใหญ่ด้วยวิธีการเส้นพรมแดนเชิงเส้นสัมพันธ์ภายใต้ทฤษฎีแบบจำลองการตั้ง
ราคาหลักทรัพย์ (CAPM). การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัย
เชียงใหม่.

Fama, E.F. and French, K.R.. 1993. "Common Risk Factors in the Returns on Stocks and Bond."
Journal of Financial Economics 33 (February): 13-15.

_____. **Fama and French Three Factor Model.** Available: <http://www.moneychimp.com/articles/risk/multifactor.htm>. (8 September 2007).

Reuters. 2005. Reuters Kobra™ Version 3.5.1. Available: Finance Investment Center, Chiangmai
University. (8 September 2007).