

## เอกสารอ้างอิง

- ฉัตรสุดา ดวงดาว. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลกระทบต่อผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธุรกิจ  
การเกษตรในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยสมการถดถอยกำลังสองน้อยที่สุดที่ตัด  
แต่งค่าคลาดเคลื่อน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547
- ขวัญหล้า จันทพันธ์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาด  
หลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2542.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2552. **บริษัทจดทะเบียนประกาศกำไรและปันผลหุ้น 2551.**  
แหล่งที่มา : [http://www.set.or.th/download/journal/text\\_mar04.pdf](http://www.set.or.th/download/journal/text_mar04.pdf). 1 กุมภาพันธ์ 2553.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2552. **Company Highlight.**แหล่งที่มา:[http://www.2.set.or.th/  
set/en/company/company\\_u4.jag](http://www.2.set.or.th/set/en/company/company_u4.jag). 1 กุมภาพันธ์ 2553.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์: พฤติกรรมการส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดค้าส่ง  
โตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย. วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
3, 3 (กันยายน-ธันวาคม 2542): 16-51.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. **ผลิตภัณฑ์มวลรวมในประเทศด้านการผลิตรายไตรมาส ณ ราคาปีฐาน  
2531.** แหล่งที่มา: [http://www.bot.or.th/bothomepage/databank/Econdata/EconFinance/  
Tab88.asp](http://www.bot.or.th/bothomepage/databank/Econdata/EconFinance/Tab88.asp). 30 ธันวาคม 2552.
- ประเสริฐ ไชยทิพย์. ทฤษฎีวงจรธุรกิจและการคาดคะเน (Business Cycle Theory and Forecasting).  
เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547.
- ปวีณา คำพุกกะ. การวิเคราะห์ดัชนีหุ้นไทยโดยวิธีการถดถอยแบบสวิตซ์. การค้นคว้าแบบอิสระ  
เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- เพชร ชุมทรัพย์. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 10. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์,

2539.

ไพฑูรย์ ไกรพรศักดิ์. เศรษฐมิติเบื้องต้น. กรุงเทพฯ: คณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2546.

หทัยรัตน์ บุญโฉ. การประมาณค่าเบต้าในแบบจำลองการกำหนดราคาสินทรัพย์ประเภททุน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2541.

Alexei, Goriaev. **Risk factors in the Russian Stock Market.** Moscow: New Economic School. Available: <http://www.ssrn.com>. 28 November 2009.

Hsu, Chih-Chiand. And Chou, Robin K. **Robust Measurement of Size and Book-to-Market Premia.** Taiwan: Department of Economics National Central University. Available: [http://www.efmaefm.org/AcceptedPapers2003/HsuChihChiang\\_ChouRobin/HsuChihchiang\\_ChouRobinK.pdf](http://www.efmaefm.org/AcceptedPapers2003/HsuChihChiang_ChouRobin/HsuChihchiang_ChouRobinK.pdf). 28 November 2009.

Dickey, David A. and Fuller, Waynes. "Distribution of the Estimates for Autoregressive Time Series with a Unit Root." **Journal of the American Statistical Association** 74 (June 1979): 427-431.

\_\_\_\_\_. "Likelihood Ratio Statistics for Autoregressive Time Series with Unit Root." **Econometrica** 49 (July 1981): 1057-1072.

Doldado, Juan. And Jenkinson, Tim. "Cointegration and Unit Roots." **Journal of Economic Surveys** 4(1990): 249-273.

Douglas, Martin. **Market Equity and Book-to-Market as Predictors of Equity Return: Robust Linear Regression Modeling.** Available: <http://www.insightful.com/DocumentLive/22/14/book-to-market.pdf>. 28 November 2009.

Enders, W. **Applied Economic Time Series.** New York: John Wiley&Sons, 1995.

Fama, E.F. and French, K.R. "The Cross-Section of Expected Stock Return." **Journal of Finance** 47(1992): 427-465.

\_\_\_\_\_. "Common risk factors in the returns on stocks and bonds." **Journal of Financial Economics** 33(1993): 3-56.

- Gregory, Connor. And Danjay, Sehgal. **Test of the Fama and French Model in India**. Dehli: University of Dehli. Available: <http://www.ssrn.com>. 28 November 2009.
- Gujarati, Damodar N. **Basic Econometrics**. New York: McGraw-Hill, 1995.
- Harrington, D.R. **Modern Portfolio Theory and CAPM**. Englewood Cliffs, NJ: Prentice-Hall, 1983.
- Heikkil, Janne. **Robust Regression**. Available: <http://www.ee.oulu.fi/~jth/robust.pdf>. 30 November 2009.
- Johnston, J. and Dinardo, J. **Econometric Methods**. Singapore: McGraw-Hill, 1997.
- Jose, Agull. And Christopher, Croux. The Multivariate Least Trimmed Squares Estimator. Available: <http://www.econ.kuleuven.be/public/ndbae06/PDF-FILES/mltspaper.pdf>+Rousseeuw,+least+trimmed+squares&hl=th. 30 November 2009.
- Kenedy, P. **A Guide to Econometrics**. Cambridge, MA: The MIT Press, 1995.
- Kenz, P. and Ready, M. **On the Robustness of Size and Book-to-Market in Cross-Section Regression**. Business School, University of Wisconsin-Madison, 1995.
- MacKinlay, A.C. and Richardson, M.P. "Using Generalized Methods of Moments to Test Mean Variance Efficiency." **Journal of Finance** 46 (1991): 511-527.
- Markowitz, Harry M. "Portfolio Selection." **Journal of Finance** (March 1952): 77-91.
- Reuters. 2009. **Reuters Kobra 3.5.1**. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 28 November 2009.
- Rousseeuw, P.J. and Hubert, Mia. **Regression Depth**. Available: <http://www.amstat.org/publications/jasa/rousseeuw.pdf>. 30 December 2009.
- Souad, Ajili. **The Capital Asset Pricing Model and the Three Factor Model of Fama and French Revisited in the Case of France**. Paris: CEREJ-University of Paris. Available: <http://www.ssrn.com>. 28 November 2009.
- Yaffee, Robert A. **Regression Analysis with Splus: Statistics, Social Sciences, and Mapping**

**Group Academic Computing Services Information Technology Services Office.**

Available: <http://www.nyu.edu/its/socsci/Docs/SPLUSreg2.pdf>. 30 December 2009.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
Copyright© by Chiang Mai University  
All rights reserved