

เอกสารอ้างอิง

- ขวัญหล้า จันทพันธ์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2540.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2547. บริษัทจดทะเบียนประกาศกำไรและปันผลหุ้น 2546. แหล่งที่มา: http://www.set.or.th/download/journal/text_mar04.pdf. 4 มกราคม 2548.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2547. แบบแสดงรายการข้อมูลประจำปี 2547 (แบบ 56-1). แหล่งที่มา: http://www.set.or.th/static/company/f56_thai_sec.html. 10 เมษายน 2548.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2547. **Company Highlight**. แหล่งที่มา: http://www.2.set.or.th/set/en/company/company_u4.jsg. 4 มกราคม 2548.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. พฤติกรรมการส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย. 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>. 28 ธันวาคม 2547.
- บริษัทหลักทรัพย์กิมเอ็ง (ประเทศไทย) จำกัด. 2548. การจัดอันดับผลตอบแทนของกลุ่มอุตสาหกรรม 20 อันดับแรกในปี 2547-2548 และการจัดอันดับผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธุรกิจการเกษตรในปี 2547-2548. แหล่งที่มา: <https://trading3.kimeng.co.th/frame.asp>. 11 เมษายน 2548
- ประเสริฐ ไชยทิพย์. ทฤษฎีวงจรธุรกิจและการคาดคะเน (Business Cycle Theory and Forecasting). เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547.
- เพชร ชุมทรัพย์. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 10. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2539.
- ไพฑูรย์ ไกรพรศักดิ์. เศรษฐมิติเบื้องต้น. กรุงเทพฯ: คณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2546.

หทัยรัตน์ บุญโญ. การประมาณค่าเบต้าในแบบจำลองการกำหนดราคาสินทรัพย์ประเภททุน.
วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2541.

Alexei, Gorjaev. **Risk factors in the Russian Stock Market.** Moscow: New Economic School.
Available: <http://www.ssrn.com>. 25 October 2004.

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>. 25 December 2004.

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>. 25 October 2004.

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 December 2004.

Hsu, Chih-Chiang 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. 25 December 2004.

- Johnston, J. and Dinardo, J. **Econometric Methods**. Singapore: McGraw-Hill, 1997.
- Jose, Agull. and Christophe, Croux. **The Multivariate Least Trimmed Squares Estimator**.
Available: [http://www.econ.kuleuven.be/public/ndbae06/PDF - FILES/mltspaper.pdf](http://www.econ.kuleuven.be/public/ndbae06/PDF-FILES/mltspaper.pdf) +
Rousseeuw,+least+trimmed+squares&hl=th. 26 December 2004.
- 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.
- Lintner, John. "The Valuation of Risk Asset and the Selection of Risky Investments in Stock Portfolio and Capital Budgets." **Review of Economics and Statistics** 47, 1 (February 1965): 13-37.
- 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.
- Mossin, Jan. "Equilibrium in a Capital Asset Market." **Econometrica** 34, 4 (October 1966): 768 - 783.
- Reuters. 2004. **Reuters Kobra 3.5.1**. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 28 October 2004.
- Rousseeuw, P.J. and Hubert, Mia. **Regression Depth**. Available: <http://www.amstat.org/publications/jasa/rousseeuw.pdf>. 26 December 2004.
- Sharp, William F. "Capital Asset Prices: A Theory of Market Equilibrium Under Condition of Risk." **Journal of Finance** 19, 3 (September 1964): 425 - 442.
- Souad, Ajili. **The Capital Asset Pricing Model and the Three Factor Model of Fama and French Revisited in the Case of France**. Paris: CEREG-University of Paris.
Available: <http://www.ssrn.com>. 25 October 2004.
- 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>. 26 December 2004.