

บรรณานุกรม

- จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2540. การลงทุน. กรุงเทพฯ : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ฉัตรสุดา ดวงดาว. 2547. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลกระทบต่อผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธุรกิจการเกษตรในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยสมการถดถอยกำลังสองน้อยที่สุดที่ตัดแต่งค่าตลาดเคลื่อน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2548ก. ข้อมูลสถิติตลาดหลักทรัพย์. แหล่งที่มา: http://www.set.or.th/static/market/market_stat.html 15 กรกฎาคม 2548.
- _____. 2548ข. ข้อมูลทั่วไปของบริษัทจดทะเบียน. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th/set/companyinfo.do?type=highlight> 26 กรกฎาคม 2548.
- _____. 2548ค. จำนวนบริษัทจดทะเบียนรวม. แหล่งที่มา: http://www.set.or.th/static/market/market_stat.html 4 สิงหาคม 2548.
- ประเสริฐ ไชยทิพย์. 2547. ทฤษฎีวงจรธุรกิจและการคาดคะเน (Business Cycle Theory and Forecasting). เชียงใหม่: เศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- รินทิพย์ จันทน์นวล. 2547. การประมาณค่าผลตอบแทนที่คาดหวังของหุ้นกลุ่มขนส่งในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยแบบจำลองฟามาและเฟรนช์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สถาพรธณ ลาภมาก. 2547. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยแบบจำลองฟาร์มาและเฟรน. วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Chung, Peter Y. ; Johnson, Herb and Schill, Michael J. 2004. "Asset Pricing when Returns are Nonnormal: Fama French vs.Higher-Order Systematic Co-Moments." **Journal of Business** (February) : 3-5.
- Dicky, David A. and Fuller, Waynes. 1979. "Distribution to the Estimates for Autoregressive Time Series With a Unit Root." **Journal of the American Statistics Association** 74(June): 427-431.
- _____. 1981 "Likelihood Ratio Statistics for Autoregressive Time Series with Unit Root." **Econometrica** 49(July): 1052-1072.

- Doldado, Juan. And Jenkinson, Tim. 1990. "Cointegration and Unit Roots." **Journal of Economic Surveys** 4: 249-273.
- Douglas, Martin. 2005 **Market Equity and Book-to-Market as Predictors of Equity Return: Robust Linear Regression Modeling**. Available: <http://www.insightful.com/documentLive/22/14book-to-market.pdf> 25 August 2005.
- Enders, W. 1995. **Applied Economic Time Series**. New York: John Wiley & Sons.
- Evan, G.B.A. and Sann, N.E. 1981. "Testing for the Unit Root:1." **Econometrica** 49 (May): 753-779.
- Faff, Robert W. 2001. "An Estimation of the Fama and French Three-Model Using Commercially Available Factors." **Australian Journal of Management** 26, 1(June):1-18.
- Fama, Eugene F. and French, Kenneth R. 1992. "The Cross-Section of Expected Stock Return." **Journal of Finance** (June): 5.
- Fama, Eugene F. and French, Kenneth R. 2001. "Multifactor Explanations of Asset Pricing Anomalies." **Journal of Finance** 51: 55-84.
- Grogory, Connor and Danjay, Sehgal. 2005. **Test of the Fama and French Model in India**. Delhi: University of Dehli. Available: <http://www.ssrn.com> 10 August 2005.
- Griffin, M. John. 2002. "Are the Fama and French Global or Country Specific?." **The Review of Financial Studies** 15: 783-803.
- Guant, Clive. 2004. "Size and Book to Market Effects and the Fama and French Three Factors Asset Pricing Model: Evidence from the Australian Stock Market." **Accounting and Finance** 44 : 27-44.
- Gujarati, Damodar N. 1995. **Basic Econometrics**. New York: Mc Graw-Hill.
- Harrington, D.R. 2005. **Modern Portfolio Theory and CAPM**. Englewood Cliffs, NJ: Prentice-Hall.
- Heikkil, Janne. 2005. **Robust Regression**. Available: <http://www.ee.oulu.fi/~jth/robust.pdf> 30 July 2005.
- Hsu, Chin-Chiang. and Chou, Robin K. 2005. **Robust Measurement of Size and Book-to-Market Premia**. Taiwan: Department of Economics National Central University. Available:http://www.efmaefm.org/AcceptedPapers2003/HsuChinChiang_ChouRobinK.pdf 30 July 2005.

- Johnson, J. and Dinardo, J. 1997. **Econometrics Methods**. Singapore: McGraw-Hill.
- Kenedy, P. 1995. **A Guide to Econometrics**. Cambridge, MA: The MIT Press.
- Kenz, P. and Ready, M. 2005. **On the Robustness of Size and Book-to-Market in Cross-Section Regression**. Wisconsin: Business School, University of Wisconsin-Madison. Available: <http://www.econ.kuven.ac.be/public/NBAE06/PAF-FILES/ECONpaper.pdf> 31 July 2005.
- Petkova, W.F.A. 2005. "Do the Fama – French Factors Proxy For Innovations in Predictive Variables." Cleveland, OH: University of Case Western Reserve Cleveland. Available: <http://www.ssrn.com> 16 July 2005.
- Reuters. 2005. **Reuters Kobra 3.5.1**. Available: Finance and Investment Center, Chiang mai University. 15 June 2005.
- Rousseeuw, P.J. and Hubert, Mia. 2005. **Regression Depth**. Available: <http://www.amstat.org/publications/jasa/rousseeuw.pdf> 3 August 2005.
- Souad, Ajili. 2005. **The Capital Asset Pricing Model and the Three Factor Model of Fama and French Revisited in the Case of French**. Paris: CEREG-University of Paris. Available: <http://www.ssrn.com> 18 August 2005.