

บรรณานุกรม

- ขวัญหล้า จันทะพันธ์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- จริญญา บาลสุข. การทดสอบแบบจำลองฟามาและเฟรนด์กับหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547.
- จิรัตน์ ตั้งซ์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2541.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. รายงานประจำปี 2547 ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2548.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2549. รายชื่อบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. [ระบบออนไลน์]. แหล่งที่มา <http://www.set.or.th/th/education/infoserv/files/companylist.xls>. (28 กุมภาพันธ์ 2549).
- นภเกตน์ เอี่ยมเพชรพงศ์. 2543. การวิเคราะห์ความเสี่ยง อัตราผลตอบแทนและการเลือกลงทุนในหลักทรัพย์กลุ่มสื่อสารโดยใช้แบบจำลอง CAPM : แบบฝึกหัดการวิจัย กระบวนวิชา Research Exercise in Economics (751409). เชียงใหม่ : คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เพชร ชุมทรัพย์. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 9. กรุงเทพฯ : สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2538.
- ยุวดี ไชยศิริ และคณะ. การลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 6. กรุงเทพฯ : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยสุโขทัยธรรมมาธิราช, 2537.
- วีรศักดิ์ สุขอารมณ์ย์. การบริหารการเงิน. พิมพ์ครั้งที่ 17. กรุงเทพฯ : สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยสุโขทัยธรรมมาธิราช, 2538.
- สิวฤทธิ์ พงศกรรังศิลป์. สถิติธุรกิจ. กรุงเทพฯ : เพียร์สัน เอ็ดดูเคชั่น อิน โค ไชน่า, 2547.
- สถาบันพัฒนาบุคลากรธุรกิจหลักทรัพย์ (TSI). หลักสูตรความรู้พื้นฐานเกี่ยวกับตลาดเงินและตลาดทุน. พิมพ์ครั้งที่ 1. กรุงเทพฯ : ห้างหุ้นส่วน สุขุมวิท มีเดีย จำกัด, 2546.
- สมหมาย ปฐมวิชัยวัฒน์. การลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 7. กรุงเทพฯ : สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยสุโขทัยธรรมมาธิราช, 2538.

Banz, R.W. **The relationship between return and market value of common stocks.** Journal of Financial Economics, 9, 1981.

Bilinski, P. and Lyssimachou, D. **Validating the Fama & French Three Factor Model ;The Case of The Stockholm Stock Exchange,1982-2002.** Industrial and Financial Economics Master Thesis No.2004:39. Available:<https://www.handels.gu.se/epc/archive/00004306>. (8 February 2006).

Bodie, Z., Kane, A. and Marcus, A. J. **Investments.** Sixth Edition, 2005.

Charitou, A. and Constantinidis, E. **Size and Book-to-Market Factors in Earning and Stock Returns : Empirical Evidence for Japan.** Available:<https://www.business.uiuc.edu/ciera/conferences/athens/papers/charitou/pdf> (24 January 2006).

Connor, G. and Sehgal, S. **Test of the Fama and French in India.** London Scholl of Economics and University of Dehli, South Campus, 2001.

Fama, E. F. and French, K. R. **The cross section of expected stock returns.** Journal of Finance, 47, 1992.

Fama, E. F. and French, K. R. **Common risk factors in the return on stock and bond.** Journal of Financial Economic, 33, 1993

Lintner, J. **The valuation of risk asset and the selection of risky investments in stock portfolios and capital budgets.** Review of Economics and Statistics, 47, 1965.

Markowitz, H. **Portfolio selection.** Journal of Finance, 1952.

Merton, R.C. **An intertemporal capital asset pricing model.** Econometrica, 41, 1973.

Mossin, J. **Equilibrium in a capital asset market.** Econometrica, 34, 1996.

Roll, R. and Ross, S. **An Empirical Investigation of Arbitrage Pricing Theory.** Journal of Finance, 35, 1980.

Rosenberg, B., Reid, K. and Lanstein, R. **Persuasive evidence of market inefficiency.** Journal of Portfolio Management, 11, 1985.

Shape, W.F. **Capital asset price : A theory of market equilibrium under conditions of risk.** Journal of Finance, 19, 1964.

Stattman, D. **Book values and stock returns.** The Chicago MBA : A journal of selected papers, 1980.