

## บรรณานุกรม

- กอบสุข สายสิงห์ทอง. 2546. การศึกษาลักษณะการปรับตัวเกินปกติของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์บริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์.
- ณัฐพงศ์ รุ่งชื่อ. 2547. การทดสอบแบบจำลอง Fama-French ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- ธนวิช ปัญญาโกษา. 2547. การประเมินพฤติกรรมการตอบสนองเกินจริงของราคาหุ้นสามัญในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การศึกษาอิสระบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2549. “ข้อมูลสถิติ”. [ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th> (26 พฤศจิกายน 2549).
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2549. “ดัชนีหลักทรัพย์”. [ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th> (26 พฤศจิกายน 2549).
- มนต์เดช ชุ่มอินทรจักร์, รวี ลงกานี และบุญญาพร พฤทธิกันนที. 2548. การตอบสนองเกินจริงของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย: พฤติกรรมเปลี่ยนแปลงราคาหลักทรัพย์หลังจากการปรับตัวของราคา 1 วัน. จุฬาลงกรณ์วารสาร. 56-69.
- Bodie Zvi, Kane Alex and Marcus J. Alan. 2005. *Investment*. 6<sup>th</sup> Edition: 396-400.
- De Bondt, W. and Thaler, Richard M. 1985. **Does the stock Market Overreact?**. The Journal of Finance. 793-805.
- Dheerapat Dhitamedhakul. 1997. **Do Stock Price Overreact?: Theory and Empirical Test**. Thammasat University, Bangkok.
- Eugene F. Fama and Kenneth R. French. 1992. **The Cross Section of Expected Stock Returns**. Journal of Finance 47: 427-465.
- Eugene F. Fama and Kenneth R. French. 1993. **Common Risk Factors in the Return on Stock and Bond**. Journal of Financial Economic 33: 427-465.
- Markowitz, Harry M. 1952. **Portfolio Selection**. Journal of Finance, Vol. 7: 77-91