

บรรณานุกรม

- ณัฐพงษ์ ฐีธู. 2547. การทดสอบแบบจำลอง Fama-French ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- ธนวิษ ปัญญาโกษา. 2547. การประเมินพฤติกรรมตอบสนองเกินจริงของราคาหุ้นสามัญในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- ภัททิรา ยอดคำลือ. 2550. การศึกษาเปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนกลุ่มหลักทรัพย์จัดตามลักษณะเฉพาะและผลตอบแทนกลุ่มหลักทรัพย์ตามผลตอบแทนที่ผ่านมาในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- มนต์เดช ชุ่มอินทร์จักร์, รวี ลงกานี และบุญสวาท พญิกานนท์. 2548. การตอบสนองเกินจริงของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย: พฤติกรรมการเปลี่ยนแปลงราคาหลักทรัพย์หลังจากการปรับตัวของราคา 1 วัน. จุฬาลงกรณ์วารสาร. 59-69.
- วิทยา มิตรานันท์. 2549. การประเมินประสิทธิภาพของกลุ่มหลักทรัพย์ที่สร้างโดยอาศัยปัจจัยพื้นฐาน. การค้นคว้าอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Banz, Rolf W. 1981. **The Relationship Between Return and Market Value of Common Stocks.** Journal of Financial Economics 9, pp. 3-18.
- Carhart, Mark M. 1997. **On Persistence in Mutual Fund Performance.** The Journal of Finance, Vol.52, No.1: 57-82.
- DeBondt, W. and Thaler, M. Richard. 1985. **Does the Stock Market Overreact?.** The Journal of Finance 40: 793-805.
- Fama, Eugene F. and Kenneth, R. French. 1992. **The Cross-Section of Expected Stock Returns.** The Journal of Finance 47: 427-465.
- Fama, Eugene F. and Kenneth, R. French. 1993. **Common Risk Factors in the Return on Stock and Bond.** The Journal of Financial Economic 33: 427-465.
- Fama, Eugene F. and Kenneth, R. French. 1996. **Multifactor Explanations of Asset Pricing Anomalies.** The Journal of Financial Economic 51: 55-84.

- Gregory Connor and Sanjay Sehgal. 2001. **Tests of the Fama and French Model in India.**
London School of Economics and University of dehli, South Campus.
- Jegadeesh, Narasimham and Sheridan Titman. 1993. **Returns to Buying Winners and Selling Losers: Implications for Stocks Market Efficiency,** Journal of Finance, 48: 65-91.
- Jensen, Michael C. 1967. **The Performance of Mutual Fund in the Period 1945-1964.**
Journal of Finance, 23: 389-416.
- Lam, Keith S. K. and Li, K. Frank. 2008. **The risk premiums of the four-factor asset pricing model in the Hong Kong stock market.** Applied Financial Economics, 18: 1667-1680.
- Lintner, John. 1965. **The Valuation of Risk Assets and the Selection of Risky Investments in Stock Portfolios and Capital Budgets.** The Review of Economics and Statistics,
Vol.47, No.1: 13-37.
- Markowitz, Harry M. 1952. **Portfolio Selection.** The Journal of Finance, Vol.7, No.1: 77-91.
- Rouwenhorst, Geert K. **International Momentum Strategies.** Journal of Finance, Vol. 53,
No. 1: 267-284.
- Sharpe, William F. 1964. **Capital Asset Prices: A Theory of Market Equilibrium under Conditions of Risk.** Journal of Finance, Vol.19: 425-442.
- Souad Ajili . 2001. **The capital asset pricing model and the three factor model of Fama and French revisited in the case of France.** Working papers, University of Paris Dauphine.