

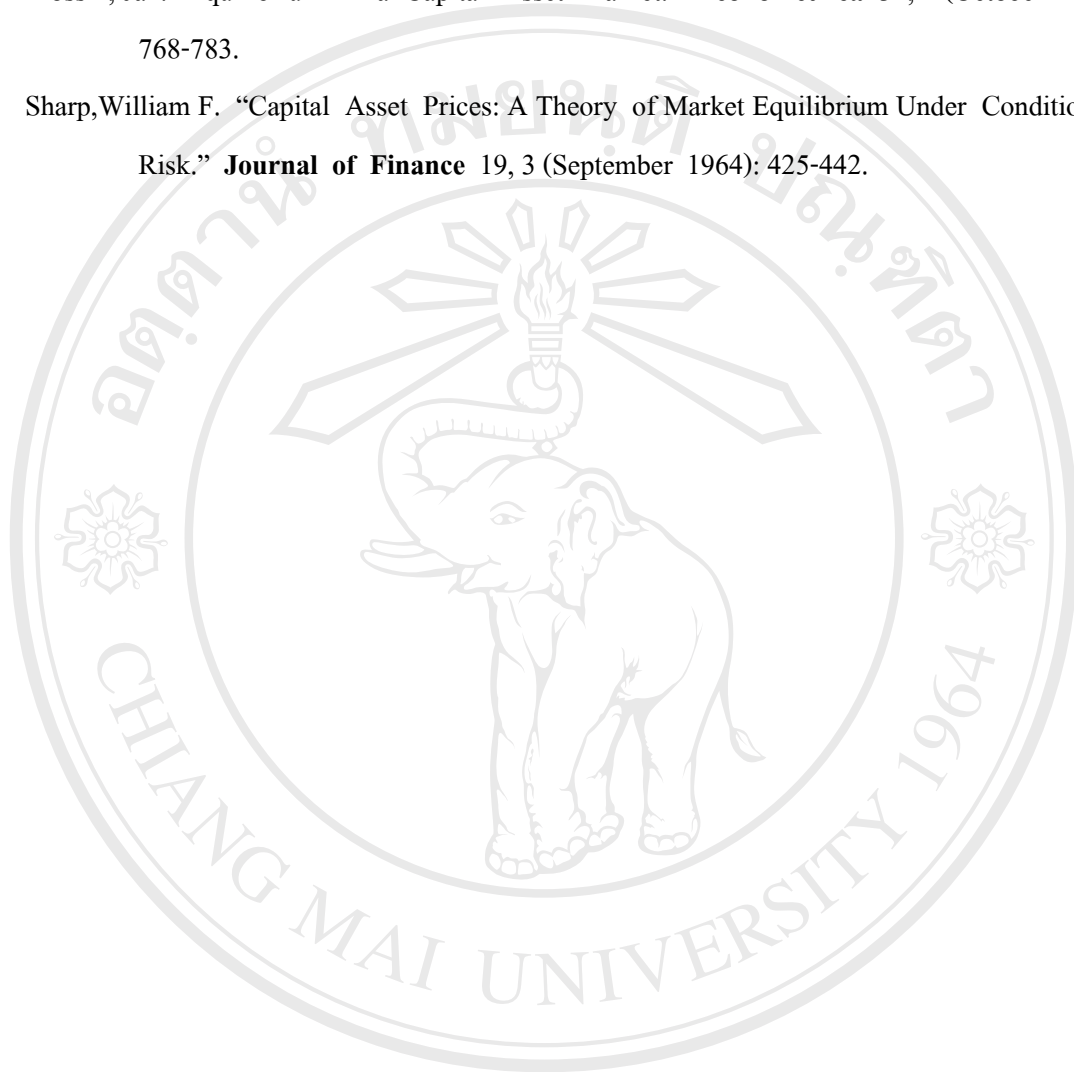
เอกสารอ้างอิง

- ขวัญหล้า จันทะพันธ์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสี่สถานะในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- จริญญา บาลสุข. การทดสอบแบบจำลองฟาร์มาและเฟรนช์กับหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. บริษัทจดทะเบียนประกาศกำไรและปันผลหุ้น 2548. แหล่งที่มา: http://www.set.or.th/download/journal/text_mar04.pdf. 4 มกราคม 2548.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. พฤติกรรมการส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้คัดบรรจุในประเทศไทย. วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 3,3(กันยายน-ธันวาคม 2542):16-51
- พรชัย จิรวินิจนันท์. การประยุกต์ใช้ทฤษฎี CAPM กับหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. กรุงเทพฯ:ภาคนิพนธ์คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์, 2535.
- เพชร ชุมทรัพย์. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 9. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2539.
- SETSMART. 2548. ข้อมูลการแตกพาร์44-48. แหล่งที่มา: http://www.sse.set/ism_homepage.jsp (16 กรกฎาคม 2548)
- Dikey, David A. and Fuller, Waynes. "Distribution of the Estimates for Autoregressive Time Series with a Unit Root." **Journal of the American Statistical Association** 74, (June1979): 427-431.
- Fama, E.F. and French, K.R. "Common Risk Factors in the Returns on Stocks and Bond." **Journal of Financial Economics** 33 (February1993): 3-15.
- . "The Cross-Section of Expected Stock Return." **Journal of Finance** 47 (1992): 427-465.
- Gregory, Connor. And Danjay, Sehgal. 2001. **Test of the Fama and French Model in India**. Dehil: University of Dehill, Available: <http://www.ssrn.com>. 25 October 2004.

Lintner, John. "The Valuation of Risk Asset and the Selection of Risk Investments in Stock Portfolio and Capital Budgets." **Review of Economics and Statistics** 47, 1 (February 1965): 13-37.

Mossin, Jan. "Equilibrium in a Capital Asset Market." **Econometrica** 34, 4 (October 1966): 768-783.

Sharp, William F. "Capital Asset Prices: A Theory of Market Equilibrium Under Condition of Risk." **Journal of Finance** 19, 3 (September 1964): 425-442.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved