

เอกสารอ้างอิง

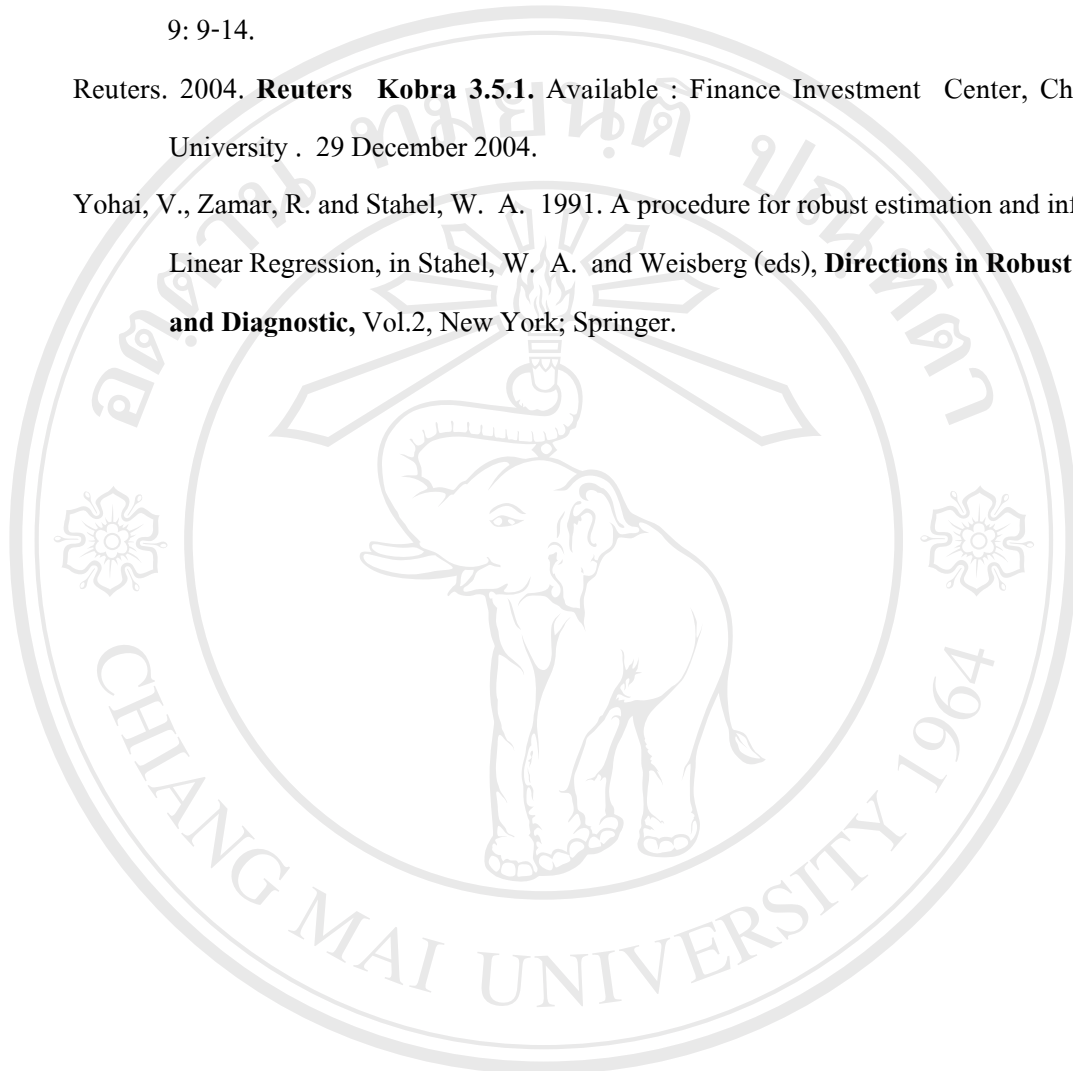
- ขวัญหล้า จันทพันธ์. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่ม
สื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหา
บัณฑิตมหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. 2540. การลงทุน. กรุงเทพฯ : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. ฝ่ายสิ่งพิมพ์. 2547. บริษัทจดทะเบียนประกาศกำไรและปันผล
2546. แหล่งที่มา: http://www.set.or.th/download/journal/text_mar04.pdf 5 มีนาคม
2548.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. สถาบันพัฒนาบุคลากรธุรกิจหลักทรัพย์. 2004. **Fact Book**
2004. กรุงเทพฯ : สถาบันพัฒนาบุคลากรธุรกิจหลักทรัพย์.
- _____. 2546. หลักสูตรความรู้พื้นฐานเกี่ยวกับตลาดเงินและตลาดทุน. กรุงเทพฯ : สุขุมวิท มีเดีย.
ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2543. เศรษฐมิตีเบื้องต้น. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัย
เชียงใหม่.
- ไพฑูรย์ ไกรพรศักดิ์. 2546. เศรษฐมิตีเบื้องต้น. กรุงเทพฯ : คณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์
มหาวิทยาลัย.
- สรุปข้อสนเทศ บริษัทจดทะเบียน 2547 เล่ม 1. 2547. กรุงเทพฯ : นิวส์ อินเทอร์เน็ต พับลิชชิง
จำกัด.
- สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์. 2547. แบบแสดงรายการข้อมูล
ประจำปี (แบบ 56-1). แหล่งที่มา : <http://www.set.or.th/set/companyinfo.do>. 12 มกราคม
2547
- หทัยรัตน์ บุญญา. 2541. การประมาณค่าเบต้าในแบบจำลองการกำหนดราคาคาสิโนหลักทรัพย์ประเภท
ทุน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Dennis O. Boudreaux. 1995. "The Monthly Effect in International Stock Markets : Evidence
and Implications." **Journal of Financial and Strategic Decisions** 8: 15-20. Available :
<http://www.studyfinance.com/jfsd/pdf/v8n1/boudreau.pdf> 10 October 2004.

- Douglas K. Pearce. 1995. The Robustness of Calendar Anomalies in Daily Stock Return. **College of Management North Carolina State University pp.** (January). Available : <http://seasonal-effects.behaviouralfinance.net/day-of-week/Pear95.pdf> 5 November 2004.
- Douglas, Martin. 1998. **Market Equity and Book- to- Market as Predictors of Equity Returns : Robust Linear Regression Modeling.** Available : <http://www.insightful.com/Documents/Live/22/14/book-to-market.pdf> 6 January 2005.
- Enders, W. **Applied Economic Time Series.** New York : John Wiley&Sons, 1995.
- Fama, Eugene F. and French, Kenneth R. 1992. "The Cross-Section of Expected Stock Return." **Journal of Finance** (June): 55.
- _____. 1993. Common Risk Factors in the Returns on Stock and Bond. **Journal of Financial Economics** 33 (February): 3-56.
- _____. 1996. Multifactor Explanations of Asset Pricing Anomalies. **Journal of Financial Economics** 51 (March):131-155.
- Goncalves, Manuel; Garay, Urbi and Gonzalez, Maximiliano. 2002. **Fama and French Factors And Stock Returns in Venezuela.** Instituto de Estudios Superiores de Administracion. Available : <http://207.36.165.114/Denver/Papers/Fama%20and%20Factors%20-%20Venezuela.pdf> 10 October 2004.
- Gregory, Connor and Sehgal, Danjay. 2001. **Test of the Fama and French Model in India.** Dehil: University of Dehli. Available: [www.lse.ac.uk/collections/accounting and finance/staff/ corner/files/Fama&FrenchIndia.PDF](http://www.lse.ac.uk/collections/accounting_and_finance/staff/corner/files/Fama&FrenchIndia.PDF) 10 September 2004.
- Gujarati, Damodar N. **Basic Econometrics.** New York: McGraw – Hill, 1995.
- Johnstone, J. 1991. **Econometric Method.** 4th ed. New York: McGraw – Hill.
- Kim Chan-Wung and Park Jinwoo . 1994. "Holiday Effects and Stock Returns: Further Evidence." **Journal of Finance and Quantitative Analysis** 29 (March): 7-12.
- Mongomery, C.D. and E.A. Peck. 1992. **Introduction to Linear Regression Analysis.** 2d ed., John Wiley and Sons, Inc., New York. 504.
- Phillips, Peter. C. B. and Perron, Pierre. 1988, "Testing for a Unit Root in Time Series Regressions." **Biometrika** 75: 335-346.

Rathinasamy R. S. and Mantripragada. Krishna G. 1995. "The January Size Effect Revisited : Is It a case of Risk Mismeasurement?" **Journal of Financial and Strategic Decisions** 9: 9-14.

Reuters. 2004. **Reuters Kobra 3.5.1**. Available : Finance Investment Center, Chiang Mai University . 29 December 2004.

Yohai, V., Zamar, R. and Stahel, W. A. 1991. A procedure for robust estimation and inference in Linear Regression, in Stahel, W. A. and Weisberg (eds), **Directions in Robust Statistic and Diagnostic**, Vol.2, New York; Springer.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved