บรรณานุกรม

ขวัญฤทัย วชิรพันธุ์สถิต. 2550. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มดัชนี SET 50 ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้แบบจำลองสามปัจจัย**. การค้นคว้าอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ณัฐพงศ์ รู้ซื่อ. 2547. **การทดสอบแบบจำลอง Fama-french ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

ธนวัช ปัญญาโกษา. 2547. **การประเมินพฤติกรรมการตอบสนองเกินจริงของราคาหุ้นสามัญในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** การค้นคว้าอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม วรรณ จำกัด. Price/Earnings to Growth Ratio. [ระบบออนไลน์]. แหล่งที่มา http://www.one-asset.com/AMClub/FunFundDetail_t.asp?id=31 (25 มิถุนายน 2552)

ภัททิรา ยอดคำลือ. 2550. **การศึกษาเปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนกลุ่มหลักทรัพย์จัดตามลักษณะเฉพาะและผลตอบแทนกลุ่มหลักทรัพย์ตามผลตอบแทนที่ผ่านมาในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**.การค้นคว้าอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

มนต์เดช ชุ่มอินทร์จักร์, รวี ลงกานี และบุญสวาท พฤษิกานนท์. 2548. **การตอบสนองเกินจริงของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย: พฤติกรรมการเปลี่ยนแปลงราคาหลักทรัพย์หลังจากการปรับตัวของราคา 1 วัน.** จุฬาลงกรณ์วารสาร. 59-69.

วิทยา มิตรานันท์. 2549. **การประเมินประสิทธิภาพของกลุ่มหลักทรัพย์ที่สร้างโดยอาศัยปัจจัยพื้นฐาน.** การค้นคว้าอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ศิวฤทธิ์ พงศกรรังศิลป์. **สถิติธุรกิจ.** กรุงเทพฯ: เพียร์สัน เอ็ดดูเคชั่น อินโดไชน่า, 2547.

หมอแว่น กบข. “มารู้จัก ratio ต่างๆ ในการวิเคราะห์หุ้นดีกว่า : P/BV (2)”. 2545. [ระบบออนไลน์]. แหล่งที่มา http://www.bkkonline.com/investment (8 สิงหาคม 2552)

Bodie Zvi , Kane Alex and Marcus J. Alan. 2005. **Investment**. Six Edition: McGraw-Hill

Brigham, Eugene F., and Ehrhardt, Michael C. 2005. **Financial Management: Theory and Practice, 11e**. Thomson South-Western.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

Carhart, Mark M. 1997. **On Persistence in Mutual Fund Performance**. The Journal of Finance, Vol.52, No.1: 57-82.

DeBondt, Werner F. M. and Thaler, Richard. 1985. **Does the Stock Market Overreact?.** The Journal of Finance 40: 793-805.

Fama, Eugene F. and French, Kenneth R.. 1992. **The Cross-Section of Expected Stock Returns.** The Journal of Finance 47: 427-465.

Fama, Eugene F. and French, Kenneth R. 1993. **Common Risk Factors in the Return on Stock and Bond.** The Journal of Financial Economic 33: 427-465.

Fama, Eugene F. and French, Kenneth R. 1996. **Multifactor Explanations of Asset Pricing Anomalies.** The Journal of Financial Economic 51: 55-84.

Jegadeesh, N. Titman, S. 1993. **Returns to Buying Winners and Selling Losers: Implications for Stocks Market Efficiency**, Journal of Finance, 48: 65-91.

Jegadeesh, N. Titman, S. 2001. **Profitability of Momentum Strategies: An Evaluation of Alternative Explanations**, Journal of Finance, 48: 65-91.

Jensen, C. Michael. 1967. **The Performance of Mutual Fund in the Period 1945-1964**. Journal of Finance, 23: 389-416.

Lam,Keith S. K. and Li, Frank K. 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.

Merton, Robert C. 1973. **An Intertemporal Capital Asset Pricing Model.** Econometrica, Vol.41, No.5: 867-887.

Mossin, Jan. 1966. **Equilibrium in a Capital Asset Market.** Econometrica, Vol.34, No.4: 768-783.

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.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

Sharpe, William F., Alexander, Gordon J., Bailey, Jeffrey V. 1995. **Investments**. Fifth Edition. Prentice Hall International, Inc.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved