

บรรณานุกรม

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย 2552, สื่อข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ [ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา
http://www.set.or.th/th/about/overview/history_p1.html

ณัฐพงษ์ รัฐชื่อ 2547, การทดสอบแบบจำลอง Fama-French ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
ไทย วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

ภัทริกา ยอดคำลือ 2550, การศึกษาเปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนกลุ่มหลักทรัพย์จัดตาม
ลักษณะเฉพาะ และผลตอบแทนกลุ่มหลักทรัพย์จัดตามผลตอบแทนที่ผ่านมาใน
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย การค้นคว้าอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

ถวิล นิลใบ 2552, The Capital Asset Pricing Model: CAPM เอกสารประกอบการบรรยายวิชา
Financial Management คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยรามคำแหง แหล่งที่มา
<http://www.eco.ru.ac.th/tawin/financial/Capm.pdf>

Chan L, Lakonishok J. 2004, Value and growth investing: review and update, *Financial
Analysis Journal*, 60, 1 71-86.

Ding DK, Chua JL and Fetherston TA. 2005, The performance of value and growth
portfolios in East Asia before the Asian financial crisis 13, 185-199.

Fama E and French K. 1992, The cross section of expect stock returns, *Journal of Finance*,
47, 427-465.

Fama E and French K. 1993, Common risk factors in the returns on stocks and bonds,
Journal of Financial Economics 33, 3 – 56.

Fama E and French K. 1995, Size and book to market factors in earnings and returns, *Journal
of Finance* 50, 131-155.

Fama E and French K. 1996, Multifactor explanations of asset pricing anomalies, *Journal of Finance* 51, 55-84.

Fama E and French K. 1998, Value versus growth: International evidence. *Journal of Finance*, 53, 1975-1999.

Fama E and French K. 2004, The Capital Asset Pricing Model: Theory and Evidence *Journal of Economic Perspectives*, 18, 25–46.

Lakonishok J, Shleifer A and Vishny RW. 1994, Contrarian investment, extrapolation, and risk. *Journal of Finance*, 49, 1541-1578.

Petkova R and Zhang L. 2005, Is value riskier than growth? *Journal of Financial Economics*, 78, 187–202.

Yen JY, Sunb Q and YanY . 2004, Value versus growth stocks in Singapore. *Journal of Multinational Financial Management*, 14, 19–34.