

เอกสารอ้างอิง

- กฤษฎา เสกตระกูล. ความสัมพันธ์ระหว่างปริมาณเงินและรายได้ : การทดสอบ Money – Income Causality กรณีของประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2534.
- กำชัย แก้วร่วมวงศ์. การวิเคราะห์เปรียบเทียบผลการตอบแทนการลงทุนหุ้นกลุ่มพลังงานและการสื่อสาร. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ขวัญหล้า จันทะพันธ์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- เจมิกา ฤกษ์วันเพ็ญ. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการส่งออกและการขยายตัวทางเศรษฐกิจของประเทศไทย โดยวิธีแกรงเกอร์คอแซลลิตี้. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547.
- เดชวิทย์ นิลวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- พัชรี เหลืองรุ่งโรจน์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นในกลุ่มสื่อสารโดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- รังสรรค์ ท้ายเสรี. “Cointegration and Error Correction Approach : ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้แบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ 13 (13 กันยายน 2538) : 20-55.
- รววิทย์ พรพิมลมิตร. ความสัมพันธ์ระหว่างการเจริญเติบโตของการส่งออกกับการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจ กรณีศึกษากลุ่มอาเซียน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2542.
- วิชัย ศรีศักดิ์สุวรรณ. การส่งออก การเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจ และความสัมพันธ์แบบเป็นเหตุเป็นผล ศึกษากรณีประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2536.

- สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์. 2548. **แบบแสดงรายการข้อมูลประจำปี(แบบ56-1)**. แหล่งที่มา: http://www.capital.sec.or.th/corp_fin2/cgi-bin/find56.php 4 เมษายน 2548.
- สุนทรฯ สุกันธา. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ธุรกิจเกษตรในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- สุโตจน์ ศรีแก้ว. **การวิเคราะห์หุ้นกลุ่มธนาคารและกลุ่มทุนหลักทรัพย์**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2535.
- โสภณ ด่านศิริกุล. **คัมภีร์หุ้น**. กรุงเทพฯ : ส.เอเชียเพรส, 2545.
- เอนก อุปรา. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มบันเทิงและสันทนาการ โดยวิธีโคอินทิเกรชัน**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547.
- อัชฌรา วงศ์วิจิตร. **การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจและการส่งออกของไทย อินโดนีเซีย มาเลเซีย เกาหลีใต้**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2546.
- โอฬาร ไชยประวัตติ. "ก้าวต่อไปของ 5 ปี Investment Project." ใน เอกสารประกอบสัมมนา เรื่อง **ก้าวต่อไปของ 5 ปี Investment Project**. เชียงใหม่ : คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2547.
- Dickey, D., and Fuller, W.A. "Distribution of the Estimators for Autoregressive Time Series with a Unit Root." **Journal of American Statistics Association** 74 (1979): 427-431.
- Enders, W. **Applied Econometric Time Series**. New York: John Wiley & Sons, 1995.
- Engle, Robert E. and Granger, Clive W.J. "Cointegration and Error-Correction : Representation, and Testing." **Econometrica** 55 (March 1987): 251-276.
- Gharte, Edward E. "Causal Relationship Between Exports and Economic Growth : Some Empirical Evidence in Taiwan, Japan, and the U.S." **Applied Economics** 25 (1993): 1145-1152.
- Granger, C.W.J. "Investigating Causality Relations by Econometric models and Cross-Spectral Methods." **Econometrica** July (1969): 424-438.
- Gujarati, D. **Basic Econometrics**. 3rd ed. New York: McGraw-Hill, 1995.

- Hataiseree, R. "Vector Autoregression, Unit Roots, Cointegration and Error-Correction Mechanism: A General Overview." **Chulalongkorn Journal of Economics** 8 (May 1996): 263-294.
- Hsiao, W. Mci-chu. "Tests of Causality and Exogeneity Between Exports and Economic Growth : The Case of Asian NICs." **Journal of Economic Development** 12 (1987): 148-159.
- Johansen, Soren and Juselius, Katerina. "Maximum Likelihood Estimation and Inference on Cointegration with Application to the Demand for Money." **Oxford Bulletin of Economics and Statistics** 52 (1990): 196-209.
- Johnston, J. and Dinardo, J. **Econometric Methods**. 4th ed. New York : McGraw-Hill, 1997.
- Jung, Woo S., and Marshall, Peyton J. "Export, Growth and Causality in Developing Countries." **Journal of Development Economics** 18 (1985): 1-12.
- Lee, S. Y. and Li, W. K. "Money, Income and Prices and their Lead Lag Relationship in Singapore." **Singapore Economic Review** 28-29 (1983-1984): 73-87.
- MacKinnon, J.G. "Critical Values for Cointegration Tests." **Long Run Economic Relationships** (1991): 267-276.
- Pindyck, Robert S. and Rubinfeld, Deniel L. **Econometric Models and Economic Forecasts**. Singapore: McGraw-Hill, 1998.
- Rahman, M. and Mustafa, M. "Dynamics of Real Exports and Real Economic Growths in 13 Selected Asian Countries." **Journal of Economic Development** 22 (December 1997): 81-84.
- Reuters, **Reuters Kobra 3.5.1**. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 30 December 2004.