

เอกสารอ้างอิง

- กัญญา กุนทีกาญจน์. 2540. เศรษฐศาสตร์มหภาคเบื้องต้น. เชียงใหม่ : มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
กิตติ ศิริพัถลภ. 2521. การใช้สมการถดถอยและค่าสหสัมพันธ์ในการหาความสัมพันธ์ระหว่าง
ราคาหุ้นในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับตัวแปรต่างๆ. วิทยานิพนธ์บัณฑิต
มหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2548. เอกสารประกอบการสอนวิชาเศรษฐมิติ. เชียงใหม่: คณะ
เศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. “พฤติกรรมการณ์ส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดระหว่าง
ตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่. 3(กันยายน-ธันวาคม): 16-15.
- ชนศักดิ์ ดันดินาคม. 2539. ปัจจัยเชิงเศรษฐศาสตร์ที่มีผลกระทบต่อดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์
แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ชนิดา กาญจนพันธ์. 2534. ผลกระทบของปัจจัยทางเศรษฐกิจต่อราคาหุ้นของไทย. วิทยานิพนธ์
เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- พิเชษฐ์ สิทธิสมบัติ. 2540. การลงทุนในหลักทรัพย์จากต่างประเทศในตลาดหลักทรัพย์แห่ง
ประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เพชร ชุมทรัพย์. 2538. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่3. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- สุชาลีณี พลอยงุ่นศรี. 2548. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณหลักทรัพย์ใน
กลุ่มสื่อสารของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบ
อิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วิลาวณีย์ เหลืองนาททองดี. 2534. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ กับ
เครื่องชี้เศรษฐกิจมหภาค. ภาคนิพนธ์ คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ (ภาคพิเศษ) สถาบัน
บัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์.
- รังสรรค์ หทัยเสรี. 2538. “Cointegration and Error Correction Approach ทางเลือกใหม่ในการ
ประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์. 3(กันยายน): 20-39.

Akaike, H. 1969. "Information Theory and an Extension of the Maximum Likelihood Principle."

In B. Pterv and F. Csake, eds., **Second International Symposium on Information Theory**. Budapest: Akademiai Kiado.

Box, G; Jenkins, G. and Reinsel G. 1994. **Time Series Analysis**. Englewood Cliffs, NJ: Prentice Hall.

Bollerslev, T. 1986. "Generalized Autoregressive Condition Heteroscedasticity." **Journal of Econometrics** 31 :307-327

Charemza, Wojciech W. and Deadman, Derek F. 1992 . **New Directions in Econometrics: General to Specific Modeling, cointegration and Vector Autoregression**. Aldershot: Edward Elgar.

Clardia, Richard H. and Taylor, Mark P. 1997. "The Structure of Forward Exchange Premiums and the Forecast ability of Spot Exchange Rates:Correcting the Error." **The Review of Economics and Statistics** 3 (August): 353-361.

Dickey, D. and Fuller, W. 1981. "Likelihood Radio Statistics for Auto regression Time Series with Unit Root." **Econometrics** 50 : 987-1008.

Enders, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series**. New York: John Wiley & Sons.

Fisher, Donald E. and Jordan, Ronald J. 1995. **Security Analysis and Portfolio Management**. Englewood Cliffs, NJ: Prentice-Hall.

Gujarati, D. 1995. **Basic Econometrics**. 3rd ed. New York: McGraw-Hill.

Granger, G.W.J. and New bold, P. 1974. "Spurious Regression in Econometrics." **Journal of Econometrics** 2: 111-120.

Harris, R.I.D. 1957. **Using Cointegration Analysis in Econometric Modeling**. London: Prentice-Hall.