

เอกสารอ้างอิง

- กัลยาณี เจริญกิจหัตถกร. 2548. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์สหรัฐอเมริกา. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ขวัญชนก ธรรมวิวัฒน์. 2543. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์กับเครื่องชี้เศรษฐกิจมหภาค. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิรวัดน์ ชูกำเนิด. 2544. การวิเคราะห์นักลงทุนแมลงเม่าในตลาดหุ้น: กรณีนักลงทุนไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. ข้อมูลสถิติ. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th> (30 มกราคม 2552)
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2547. เกล็ดไม้ลับการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. ปัจจัยที่เกี่ยวข้องในการลงทุน. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th.htm> (16 กุมภาพันธ์ 2550)
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตติ: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ชนิดา กาญจนพันธ์. 2543. ผลกระทบของปัจจัยทางเศรษฐกิจต่อราคาหุ้นของไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

นลินี โอภาสขวลิต. 2548. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับดัชนี
หุ้นตลาดหลักทรัพย์ในสหภาพยุโรป. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

นันทน์ภัส เลิศจรยารักษ์. 2548. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างตัวแปรเศรษฐกิจมหภาคและ
การลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศในประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

พริ้มรวี สมงาม. 2546. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับ
ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ในภูมิภาคเอเชีย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

รังสรรค์ หทัยเสรี. 2538. “Cointegration and Error Correction Approach: ทางเลือกใหม่ในการ
ประยุกต์ใช้แบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์
ธรรมศาสตร์ 13 (กันยายน): 20-55.

สลิลทิพย์ ศรีไพบลุย์. 2546. ปัจจัยที่กำหนดดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
ระหว่างปี ค.ศ. 1995-2001. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

Charemza, W. and Deadman, D. 1992. **New directions in econometric practice.** Cambridge:
University.

Enders, Walter. 1995. **Applied econometric time series.** New York: John Wiley & Sons.

Engle, R. “Wald, likelihood ratio, and lagrange multiplier test in econometrics.” In Griliches, Zvi
and Michael, D. 1984. **Handbook of Econometrics Vol. II.** North Holland: McGraw-
Hill. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. “พฤติกรรมการณ์ส่งผ่าน
ราคาหุ้นตลาดระหว่างตลาดค้าส่งโตเกียวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสาร
เศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 3: 16-51.

- Engle, R.W. and Granger, C.W.J. 1987. "Cointegration and Error Correction: Representation, Estimation and Testing." **Econometrica** 55: 251-276.
- Fama, E.F. 1970. "Efficient capital markets: a review of theory and empirical work". **Journal of Finance**. 25: 383-417.
- Gujarati, D.N. 2003. **Basic econometrics**. 3rd ed. New York: McGraw-Hill.
- Gujarati, D.N. 2003. **Basic econometrics**. 4th ed. New York: McGraw-Hill.
- Hendry, D.F. and Richard, J.F. 1983. "The econometric analysis of economic time series." **International of Statistics Review** 51: 3-33. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. "พฤติกรรมการณ์ส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดระหว่างตลาดค้าส่งโตเกียวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย." **วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่** 3: 16-51.
- Johnston, J. and Dinardo, J. 1997. **Econometric methods**. 4th ed. New York: McGraw-Hill.
- Johansen, S. 1988. "Statistical analysis of cointegration vectors." **Journal of Economic Dynamics and Control** No.12
- Johansen, S. and Juselius, K. 1990. "Maximum likelihood estimation and inference on cointegration: With applications to the demand for money." **Oxford Bulletin of Economics and Statistics** 52: 169-210.
- Maddala, G.S. 1992. **Introduction to econometrics**. 2nd ed. New York: Macmillan Publishing.
- Orawan Ratanapakorn and Subhash, C. 2002. "Interrelationships among regional stock indexes." **Review of Financial Economics** 11: 91-101.
- Patterson, K. 2000. **An introduction to applied econometrics**. London: Macmillan Press Ltd.

Pindyck, R.S. and Rubinfeld, D.L. 1998. **Econometric models and economic forecasts**. 4th ed.
New York: McGraw-Hill.

Sims. 1980. "Macroeconomics and Reality." **Econometrica**. 48: 1-49.

Stock, J. and Watson. 1988. "Variable trend in economic time series." **Journal of Economics
Perspective** 2: 147-174.

Taylor, E; Bessler, D.; Waller, M. and Rister, M. 1996. "Dynamic Relationship Between US and
Thai Rice Prices" **Agricultural Economics**, Blackwell, vol. 14: 123-13.
University.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved