

เอกสารอ้างอิง

กัลยา วานิชย์บัญชา. การวิเคราะห์ข้อมูลด้วย SPSS for Windows. พิมพ์ครั้งที่ 2 กรุงเทพมหานคร:

จุฬาลงกรณ์ มหาวิทยาลัย

กัลยาณี เจริญกิจหัตถกร. 2548. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์อเมริกา. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต บัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

คำระวางเรือบอลติกทราย. มกราคม 2554. แหล่งที่มา: <http://www.futuresource.quote.com>

ชนัญชิตา ศรีสกุล. 2553 การเปรียบเทียบปัจจัยที่มีผลต่อการส่งออกของไทยไปยังประเทศสหรัฐอเมริกา และกลุ่มประเทศบริคโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต บัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตติ : ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่ : คณะเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต บัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ทรงศักดิ์ ภูสีอ่อน. 2551. การประยุกต์ใช้ SPSS วิเคราะห์ข้อมูลงานวิจัย. กภาพสินธุ์: ประสานการพิมพ์
นงลักษณ์ วิรัชชัย. 2542. โมเดลลิสเรดสถิติวิเคราะห์สำหรับการวิจัย. กรุงเทพฯ: จุฬาลงกรณ์
มหาวิทยาลัย.

นลินี โอภาสชวลิต. 2548 ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับดัชนีหุ้นตลาดหลักทรัพย์ในสหภาพยุโรป. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต บัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

บริษัท บรูคเคอร์ กรุ๊ป จำกัด(มหาชน). 2551. คู่มือหุ้นไทย 2550/2551. “สรุปข้อมูลบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ไทย”

บริษัทหลักทรัพย์ คันทรี กรุ๊ป จำกัด(มหาชน). 2554. สถิติราคาหุ้น. แหล่งที่มา: <http://www.cgsec.co.th>
ราคาหลักทรัพย์หุ้นบริษัทเดินเรือ. มกราคม 2554. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th>

ประหยัด จิโนเป็ง. 2551. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดเอ็มเอที โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต บัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- นพจน์ บุญชัย. 2551. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณการซื้อขายของหลักทรัพย์ในกลุ่ม
 บรรจุก่อนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระ
 เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต บัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- มฤตพร คงห้วยรอบ. 2550. การวิเคราะห์ความเสี่ยงตามการเปลี่ยนแปลงของเวลาของหลักทรัพย์ในกลุ่ม
 เทคโนโลยีในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต
 บัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วินัส ฤชาชัย. พฤษภาคม 2547. เศรษฐศาสตร์สถิติ **Economic Statistics**. พิมพ์ครั้งที่ 2
- สนธิ อังสนากุล. 2547. มหัทศจรยแห่งเทคนิค การวิเคราะห์หุ่นทางเทคนิค. พิมพ์ครั้งที่ 1 บริษัท ซีเอ็ด
 ยูเคชั่น จำกัด(มหาชน)
- สายสุดา จันทรา. 2548. ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศกับดัชนีตลาด
 หลักทรัพย์บางประเทศในเอเชีย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต บัณฑิตวิทยาลัย
 มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สำราญ มีแจ้ง. สถิติขั้นสูงสำหรับการวิจัย. ภาควิชาการศึกษา คณะศึกษาศาสตร์
- อัครพงศ์ อันทอง. 2546. คู่มือการใช้โปรแกรม EViews เพื่อการวิเคราะห์ Unit Root, Cointegration และ
 Error Correction Model(ตามวิธีการของ Engle and Granger). เชียงใหม่: สถาบันวิจัยสังคม
 มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- Braun, P.A. and S. Mitnik. 1993. Misspecifications in Vector Autoregressions and their Effects on
 Impulse Responses and Variance Decompositions. **Journal of Econometrics** 59, 319-341
- Dickey, D.A. and Fuller, W.A. 1981. "Likelihood ratio statistics for autoregressive time series with unit
 root" **Econometrics** 49, 4(July): 1057-1071
- Engle, R.W. and Granger, C.W.J. 1987. "Cointegration and Error Correction: Representation,
 Estimation and Testing." **Econometrica** 55: 251-276.
- Enders, Walter. 1995. **Applied econometric time series**. New York: John Wiley & Sons.
- Eric Zivot and Jiahui Wang. 2006. **MODELING FINANCIAL TIME SERIES WITH S-PLUS**. 2rd
 ed.
- Gujarati, Damodar N. 1995. **Basic econometrics**. 3rd ed. New York: McGraw-Hill. Quoted in
 Dimitrova, Desislava. 2005. "The relationship between exchange rates and stock prices: Studied
 in a Multivariate model." **Political Economy The College of Wooster** 14 (August)
- Gujarati, Damodar N. 2003. **Basic econometrics**. 4rd New York: McGraw-Hill

- Hafer, R W and Sheehan, Richard G. 1991. "Policy Inference Using VAR Models," **Economic Inquiry**. Oxford University Press, vol. 29, pages 44-52, January.
- Johnston, J. and Dinard, J. 1997. *Econometric methods*. 4rd ed. New York: McGraw-Hill
- Johansen, S. 1988. "Statistical analysis of cointegration vectors." **Journal of Economic Dynamics and Control** no. 12
- Lütkepohl, H. and D.S. Poskitt. 1996. Testing for Causation Using Infinite Order Vector Autoregressive Processes. **Econometric Theory** 12, 61-87
- Ng, S and P. Perron 2001. "Lag Length Selection and the Construction of Unit Root Tests with Good Size and Power," **Econometrica**, 69, 1519-1554
- Ruey S. Tsay. 1991. **Analysis of Financial Time Series** 2rd ed. A John Wiley & Sons; 2005
- 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, 14: 123-13.
- Walter A Shewhart and Samuel S. Wilks. 1948 **Applied econometric time series**. 2rd ed.
- Taylor, E; Bessler, D.; Waller, M. and Rister, M. 1996. "Dynamic relationship between US and Thai rice prices" **Agricultural Economics**, Blackwell, 14: 123-13.