

เอกสารอ้างอิง

- กรรณิการ์ ไชยลังกา. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ธนาคารพาณิชย์ขนาดกลางในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ขวัญชนก ชรรณวิวัฒน์. 2543. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์กับเครื่องชี้เศรษฐกิจมหภาค. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตติ. ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ธนาคารเพื่อการส่งออกและนำเข้าแห่งประเทศไทย. "ตลาดหลักทรัพย์ SMEs." ทิศทางการส่งออกและลงทุน, กรุงเทพฯ : บริษัท เปรียวจำกัด, 2543.
- สุโลจน์ ศรีแก้ว. 2535. การวิเคราะห์หุ้นกลุ่มธนาคารและกลุ่มทุนหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปวีณา คำพุกกะ. 2545. การวิเคราะห์ดัชนีหุ้นไทยโดยวิธีการถดถอยแบบสวิซชิง. วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตร์มหาบัณฑิต (สาขาวิชาสถิติประยุกต์) มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- พรรณี อิศรพงศ์ไพศาล. 2520. การเลือกการลงทุนซื้อหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- Ajayi, R. A. and Mougoue, M. 1996. "On the dynamic relation between stock prices and Exchange rate." The Journal of Financial Research 19:193-207.
- Association of Southeast Asian Nations. 2007. **About ASEAN: Overview ASSOCIATION OF SOUTHEAST ASIAN NATIONS.** Available: <http://www.aseansec.org/64.htm> (December 20, 2007)
- Baltagi, Badi Ho. 2001. **Econometric analysis of panel data.** 2nd ed. West Sussex: John Wiley & Son.
- Choi, I. 2001. "Unit root test for panel data." Journal of International Money and Finance 20: 249-272.
- 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**. 4th ed. Singapore: McGraw-Hill.
- Hadri, Kaddour. 2000. “**Testing for stationary in heterogeneous panel data.**” *Econometric Journal* 3: 148-161.
- Hansen, Bruce E. 1992. “**Efficient estimation and testing of cointegrating vectors in the presence of deterministic trends.**” *Journal of Econometrics* 53: 87-121.
- Im, K.S; Pesaran, M.H and Shin, Y. 2003. “**Testing for unit roots in heterogeneous panels.**” *Journal of Econometrics* 115: 53-74.
- Kao, Chihwa. 1999. “**Spurious regression and residual-based tests for cointegration in panel data.**” *Journal of Econometrics* 90 (1): 1-44.
- Levin, A; Lin, C.F and Chu, C. 2002. “**Unit root tests in panel data : Asymptotic and finitesample properties.**” *Journal of Econometrics* 108: 1-24.
- Pedroni, P. 1999. “**Critical values for cointegration tests in heterogeneous panels with multiple regressors.**” *Oxford Bulletin of Economics and Statistics, Special Issue*. p. 653-670.
- Verbeek, Marno. 2004. **A guide to modern econometrics**. 2nd ed. West Sussex: John Wiley & Sons.
- Ziet, J. and Pemberton, D.1990. “The U.S. budget and trade deficits : A simultaneous equation Module.” **South Economic Journal** 57:23-24.