

บรรณานุกรม

ภาษาไทย

- กนกกาญจน์ ทวีอภิชาติเจริญ. ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อราคาหุ้นหมวดอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2541.
- ขวัญชนก ธรรมวิวัฒน์. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์กับเครื่องชี้เศรษฐกิจมหภาค. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2543.
- ธนศักดิ์ ต้นตินาคม. ปัจจัยเชิงเศรษฐศาสตร์ที่มีผลกระทบต่อดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- นินนาท เจริญเลิศ. ปัจจัยกำหนดการลงทุนในหลักทรัพย์และแนวทางการพัฒนาตลาดหลักทรัพย์ในอนาคต. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2532.
- บุญชัย เกียรติธนาวิทย์. ปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีอิทธิพลต่อราคาหุ้นกลุ่มธนาคารพาณิชย์และบริษัทเงินทุนและหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2534.
- บุญศรี ตรีหิรัญกุล. ปัจจัยที่มีผลกระทบต่ออัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในหลักทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- พิมลพรรณ สุระวาศรี. แบบจำลองเศรษฐกิจสำหรับการบริโภคและการออมของประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- เมธินี รัศมีวิจิตรไพศาล. ความสัมพันธ์ระหว่างปริมาณเงินกับราคาหลักทรัพย์ในประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2530.

รังสรรค์ หทัยเสรี. "Cointegration and Error Correction Approach: ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของประเทศไทย." *วารสารเศรษฐศาสตร์ธรรมศาสตร์ธรรมศาสตร์* 13(กันยายน 2538): 20 - 55.

สุโลจน์ ศรีแก้ว. *การวิเคราะห์หุ้นกลุ่มธนาคาร และกลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์*. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2535.

สุชาติ ธาราอำรงเวช. *แบบจำลองเศรษฐกิจมหภาคที่มีดุลยภาพโดยทั่วไปสำหรับประเทศไทย*. กรุงเทพฯ : คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยรามคำแหง, 2527.

สุชาติ อุบริพุทธิพงศ์. *ผลกระทบของปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีต่อดัชนีตราสารหนี้*. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2542.

ภาษาอังกฤษ

Charemza, Wojciech W. and Deadman, Derek F. *New Directions in Econometric Practice: General to Specific Modeling, Cointegration and Vector Autoregression*. Aldershort: Edward Elgar, 1992.

Clardia, Richard H. and Taylor, Mark P. "The Term Structure of Forward Exchange Premiums and The Forecastability of Spot Exchange Rate: Correcting The Errors." *The Review of Economics and Statistic* (August 1997): 353-361.

Dickey A. David and Wayne A. Fuller. "Distribution of the Estimators For Autoregressive Time Seria With a Unit Root." *Journal of the American Statistical Association* 74 (June 1979): 427-431.

_____. "Likelihood Ratio Statistics for Autoregressive Time Series with a Unit Root." *Econometrica* 49 (July 1981): 1057-1072.

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

Engle, Robert F. and Granger, C.W.J. "Co-integration and Error Correction: Representation, Estimation, and Testing." *Econometrica* 55 (March 1981): 251-276.

- Harris, R.I.D. *Using Cointegration Analysis in Econometric Modelling*. London: Prentice Hall, 1995.
- Hoffman, D.L. and Rasche, R.H. 1997. *STLS/US-VECM 6.1: A Vector Error-Correction Forecasting Model of the U.S. Economy: Working Paper 97-008A*. ST. Louis: Federal Reserve Bank of ST. Louis.
- Johansen, S. and Juselius, K. "Maximum Likelihood Estimation and Inference on Cointegration-with Applications to the Demand for Money." *Oxford Bulletin of Economics and Statistics* 52 (1990).
- Johnston, J. and Dinardo, J. *Econometric Methods*. Singapore: McGraw-Hill, 1997.
- Maddala, G.S. and In-Moo Kim. *Unit Roots Cointegration and Structural Change*. Cambridge: Cambridge University Press, 1998.
- Reuters. 2003. *Reuters Kobra 3.5.1*. [Online]. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 20 February 2003.
- Wolters, J. "Cointegration and German Bond Yield." *Applied Economics Letters* 5 (1998): 497-502.
-