

## เอกสารอ้างอิง

- นฤมล เชาวนวิทย์ทางกูร. 2542. ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนในตลาดแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ กับตลาดหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ณพล หงสกุลวสุ. 2550. ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนและการเคลื่อนย้ายทุนของประเทศในเอเชีย. วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ไทรทศ กลิ่นอุทัย. 2552. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับราคาหลักทรัพย์ของกลุ่มขนส่งและโลจิสติกส์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตติ: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- นภาพร แซ่เตียว. 2550. การดำเนินนโยบายการเงินผ่านช่องทางอัตราแลกเปลี่ยนและผลกระทบต่อระบบเศรษฐกิจไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ประสาร บุญเสริม. 2550. “ดัชนีเลือกช่วงเวลาล่าช้าที่เหมาะสมของแบบจำลอง VAR.” ใน จูรี ตาปนานนท์, บรรณาธิการ. จุลสารเศรษฐศาสตร์. หน้า 100-109. กรุงเทพฯ: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยรามคำแหง.
- สิรินธร คำตันสมบัติ. 2552. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับราคาหลักทรัพย์ของกลุ่มอสังหาริมทรัพย์และก่อสร้างในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สิรินภา ศรีมณี. 2551. ผลกระทบของวิกฤตการณ์ราคาน้ำมันต่อระบบเศรษฐกิจมหภาค. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

สายสุดา จันทรา. 2547. ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศกับดัชนีตลาดหลักทรัพย์บางประเทศในเอเชีย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

สิรินธร คำตันสมบัติ. 2552. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับราคาหลักทรัพย์ของกลุ่มอสังหาริมทรัพย์และก่อสร้างในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

อารีย์ เชื้อเมืองพาน. 2546. การวิเคราะห์การลงทุนในตลาดการเงิน: เอกสารประกอบการสอน. เชียงใหม่: คณะธุรกิจการเกษตร มหาวิทยาลัยแม่โจ้.

อุษยา แพทย์เจริญ. 2552. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับดัชนีหมวดธุรกิจในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

Ajayi, R. A. and Mougoue, M. 1996. "On the dynamic relation between stock prices and exchange rates" **The Journal of Financial Research** 19: 193-207.

Bhattacharya, Basabi and Mukherjee, Jaydeep. 2002. "Causal Relationship Between Stock Market and Exchange Rate, Foreign Exchange Researves and Value of Trade Balance: A Case Study For India." **The Quarterly Review of Economics and Finance**, 45: 395-411.

Dimitrova, Desislava. 2005. "The relationship between exchange rates and stock prices: Studied in a Multivariate model." **Political Economy The College of Wooster** 14 (August).

Appleyard, D. R. and Field, A. J. 2001. **International economics**. 4th ed. Singapore: McGraw-Hill.

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

Gujarati, Damodar N. 1995. **Basic econometrics**. 3rd ed. New York: McGraw-Hill.

Krueger, A. O. 1983. **Exchange-rate determination**. Cambridge: Cambridge University.

- Muhammad, Naeem and Rashee, Abdul. 2002. "Stock prices and Exchange Rates: Are they Related? Evidence from South Asian Countries." **Japan and the World Economy**, 10: 505-520.
- Mishkin, F. S. 2001. **The transmission mechanism and the role of asset prices in monetary policy**. Working paper 8617. NBER, Cambridge; MA.
- Pan, Ming-Shiun; Fok, Chi-Wing Robert and Liu, Y. Angela. 2001. "Dynamic linkages between exchange rates and stock prices - Evidence from East Asian Markets." **International Review of Economics and Finance**, 16: 505-520.
- Pindyck, R.S. and Rubinfeld, D.L. 1998. **Econometric Models and Economic Forecasts**. 4<sup>th</sup> ed. New York: McGraw-Hill.
- Phylaktis, Kate and Ravazzolo, Fabiola. 2005. "Stock Prices and Exchange Rate Dynamics." **Journal of International Money and Finance**, 24: 1031-1053.
- Zietz, J. and Pemberton, D. 1990. "The U.S. budget and trade deficits: A simultaneous equation model." **Southern Economic Journal** 57: 23-34.