

เอกสารอ้างอิง

- จิรัตน์ สังข์แก้ว. (2540). การลงทุน. กรุงเทพฯ. โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- นัทรสุดา ดวงดาว. (2547). การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลกระทบต่อผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธุรกิจการเกษตรในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยสมการถดถอยน้อยที่สุดที่ตัดแต่งค่าคลาดเคลื่อน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่. ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. (2553). ข้อมูลสถิติตลาดหลักทรัพย์. แหล่งที่มา: http://www.set.or.th/static/market/market_stat.html 13 กันยายน 2553.
- _____. (2553). ข้อมูลทั่วไปของบริษัทจดทะเบียน. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th/set/co/mpanyinfi.do?type=highlight> 13 กันยายน 2553.
- ประเสริฐ ไชยทิพย์. (2547). ทฤษฎีวงจรธุรกิจและการคาดคะเนขั้นสูง. เชียงใหม่. คณะเศรษฐศาสตร์, มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- รังสรรค์ หทัยเสรี. (2538). “Cointegration and Error Correction Approach : ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ ธรรมศาสตร์ 13, 20 -55.
- รัชดา ดันประเสริฐ. (2549). การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลกระทบต่อผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มที่เข้าใหม่ ปี พ.ศ. 2546-2547 ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยใช้วิธีการถดถอยกำลังสองน้อยที่สุดที่ตัดแต่งค่าคลาดเคลื่อน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- รุจิรา กุศลเลิศจริยา. (2551). การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างดุลสินค้าและบริการกับอัตราแลกเปลี่ยนของ ประเทศกำลังพัฒนา. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สำนักดัชนีเศรษฐกิจการค้า. (2553). ดัชนีขายส่งสินค้าวัสดุก่อสร้าง. แหล่งที่มา: <http://www.price.moc.go.th/Default5.aspx> 13 กันยายน 2553.
- Bahmani-Oskooee, Mohsen. (1998). “Cointegration Approach to Estimate the Long-run Trade Elasticities in LDCs”. *International Economic Journal*. 12, 89-96
- Bahmani-Oskooee, Mohsen and Brooks, Taggart J. (1999). “Bilateral J-Curve between U.S. and Her Trading Partners”. *Weltwirtschaftliches Archiv*. 135, 156-165.

- Bahmani-Oskooee, Mohsen and Tanchawan Kantipong. (2001). "Bilateral J-curve between Thailand and Her Trading Partners". **Journal of Economics Development**. 26, 107-117.
- Bahmani-Oskooee, Mohsen and Goswami, Gour. (2003). "A Disaggregated Approach to Test the J-Curve Phenomenon: Japan versus Her Major Trading Partners". **Journal of Economics and Finance**. 27, 102-113.
- Banerjee, Anindya, Juan J. Dolado, John W. Galraith and David F. Hendry. (1993). **Co-integration, Error Correction, and the Econometric Analysis of Non-stationary Data**. Oxford. Oxford University Press.
- Dicky, David A. and Fuller, Waynes. (1979). "Distribution to the Estimates for Autoregressive Time Series with a Unit Root". **Journal of the American Statistics Association**. 74, 427-431.
- _____. (1981). "Likelihood Ratio Statistics for Autoregressive Time Series with a Unit Root". *Econometrica*. 49, 1052-1072.
- Ender, Walter. (1995). **Applied econometrics time series**. New York: John Wiley & Sons.
- Engle, R. F. and Granger, C.W.J. (1987). "Cointegration and Error Correction: Representation, Estimation and Testing". **Econometrica**. 55, 251-276.
- Johansen, S. (1988). "Statistical Analysis of Cointegration Vector". **Journal of Economic Dynamics and Control**. 12, 231-254.
- Johansen, S and K. Juselius. (1990). "Maximum Likelihood Estimation and Inference on Cointegration: With Applications to the Demand for Money". **Oxford Bulletin of Economics and Statistics**. 52, 169-210.
- Johansen, S. (1991). "Estimation and Hypothesis Testing of Cointegration Vector Autoregressive Models". **Econometrica**. 59, 1551-1580.
- Laurenceson, James and Joseph C.H. Chai. (2003). **Financial Reform and Economics Development in China**. Cheltenham. UK. Edward Elgar.
- Min B. Shrestha. (2006). "ARDL Modelling Approach to Cointegration Test". **Working Paper Series No. 1/2006**. University of Wollongong. Northfields Avenue. New South Wales. Australia.

- Muhammad Shahbaz and Nadeem Ahmed and Liaquat Ali. (2008). "Stock Market Development and Economic Growth: Ardl Causality in Pakistan". **International Research Journal of Finance and Economics**. 14, 182 – 195. EuroJournals Publishing Inc.
- Park, Y.C. (1990). "Development Lessons from Asia: the Role of Government in South Korea and Taiwan". **Journal of Money, Credit and Banking**. 139-154.
- Pesaran, M.H. and Shin, Y. (1995). "Autoregressive Distributed Lag Modeling Approach to Cointegration Analysis". **DAE Working Paper Series No 9514**. Department of Economics, University of Cambridge.
- Pesaran, M.H. (1997). "The Role of Economic Theory in Modelling the Long-Run". **DAE Working Paper Series No 9622**, Economics Journal. 107, 178 - 191.
- Pesaran, M.H., Shin, Y. and Smith, R. (1998). "Testing the Existence of a Long-Run Relationship". **DAE Working Paper Series No 9622**. Department of Applied Economics. University of Cambridge.
- Pesaran, M.H. and Shin, Y. (1999). "An Autoregressive Distributed Lag Modelling Approach to Cointegration Analysis". In Storm, S., ed. **Econometrics and Economic Theory in the 20th Century: the Ragnar Frisch Centennial Symposium**. Chapter 11. Cambridge University Press. Cambridge.
- Pesaran, M.H., Shin, Y. and Smith, R. J. (2001). "Bounds Testing Approache to the Analysis of Level Relationships". **Journal of Applied Econometrics**. 16, 289 - 326.
- Pesaran, M.H., and Pesaran, B. (2009). **Time Series Econometrics using Mircrofit 5.0**. Oxford University Press. Oxford.
- Prasert Chaitip, N. Rangaswamy and Chukiati Chaiboonsri. (2006). "Modeling International Tourism Demand in Thailand". **Working Paper Series 3/2006**. LSD Center Chiang-Mai, Thailand.
- Reuters. (2010). **Reuters Kobra 3.5.1**. Available: Finance and Investment Center, Chiangmai University. 19 November 2010.
- Shin, Y. (1994). "A Residual-Based Test of Null of Cointegration Against the Alternative of No cointegration. **Econometric Theory**. 10, 91-115.

Shrestha, Min B. and Khorshed Chowdhury. (2006). "A Sequential Procedure for Testing Unit Roots in the Presence of Structural Break in Time Series Data: An Application to Nepalese Quarterly Data 1970-2003". **International Journal of Applied Econometrics and Quantitative Studies 2.**

Stock, J.H. and Watson, M.W. (1988). "Testing for common trend". **Journal of the American Statistical Association.** 83, 1097-1107.