

เอกสารอ้างอิง

กรมส่งเสริมการค้าส่งออก. 2549. ข้อมูลพื้นฐานรายประเทศ. แหล่งที่มา : <http://www.depthai.go.th>. 10 มกราคม 2549.

กัลยาณี เจริญกิจหัตถกร. 2548. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ในสหรัฐอเมริกาที่มีความสัมพันธ์กับดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2548. เคล็ดไม่ลับการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์. กรุงเทพฯ : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2548. รู้จักกับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. กรุงเทพฯ : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. “พฤติกรรมการณ์ส่งผ่านราคาหุ้นในตลาดระหว่างตลาดค้าส่งโตเกียวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 3: 16-51.

ชนศักดิ์ ดันดินาคม. 2539. ปัจจัยเชิงเศรษฐศาสตร์ที่มีผลกระทบต่อดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

นลินี โอภาสชาติ. 2548. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับดัชนี ราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ในสหภาพยุโรป. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

พรวิมลวิ สมงาม. 2546. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ในภูมิภาคเอเชีย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

รังสรรค์ หทัยเสรี. 2538. “Cointegration and Error Correction Approach: ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ ธรรมศาสตร์ 13 (กันยายน): 20-55.

อัมพวัน นันทขว้าง. 2545. ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยของนัก ลงทุนรายย่อยในจังหวัดเชียงใหม่. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- Choudhry, Taufiq. 1996. "Interdependence of Stock Markets: Evidence from Europe During the 1920s and 1930s." **Applied Financial Economics** 6, 3(June): 243-249.
Available:<http://taylorndfrancis.metapress.com/link.asp?id=101479> January 2005
- Enders, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series**. New York: John Wiley & Sons.
- Engle, R. 1984. "Wald, Likelihood Ratio, and Lagrange Multiplier Tests in Econometrics." In **Handbook of Econometrics Vol II**. Edited by Zvi Griliches and Michael, D. Intriligator. North Holland: McGraw-Hill: 776-826. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงษ์ . 2542 . "พฤติกรรมการณ์ส่งผ่านราคาหุ้นในตลาด ระหว่างตลาดค้าส่งโตเกียวกับตลาดผู้ค้าบรรจในประเทศไทย. " **วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่** 3: 16-51.
- Gujarati, D.N. 2003. **Basic Econometrics**. 4th ed. New York: McGraw-Hill, 2003
- Hendry, D.F. and Richard, J.F. 1983. "The Econometric Analysis of Economic Times Series." **International of Statistics Review** 51: 3-33, อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์และอารี วิบูลย์พงษ์. 2542 . "พฤติกรรมการณ์ส่งผ่านราคาหุ้นในตลาด ระหว่างตลาดค้าส่งโตเกียวกับตลาดผู้ค้าบรรจในประเทศไทย." **วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่** 3: 16-51.
- Johnston, J. and Dinardo, J. 1997. **Econometric Methods**. 4th ed. New York: McGraw-Hill.
- Johansen, S. 1988. "Statistical Analysis of Cointegration Vectors." **Journal of Economic Dynamics and Control** 12: 90-100
- Maddala, G.S. 1992. **Introduction to Econometrics**. 2nd ed. New York: Macmillan.
- Microfit. [Computer Program]. Oxford. Polyhedron Software, 1997
- Orawan Ratanapakorn and Sharma, Subhash C. 2002. "Interrelationships Among Regional Stock Indexes." **Review of Financial Economics** 11: 91-101, Available: <http://www.sciencedirect.com> 20 December 2004.
- Pindyck, R.S. and Rubinfeld, D.L. 1998. **Econometric Models and Economic Forecasts**. 4th ed. New York: McGraw-Hill.
- Reuters. 2005. **Reuters Kobra 3.5.1**. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 27 December 2005.