

เอกสารอ้างอิง

กิตติ ศิริพัลลภ. 2521. การใช้สมการถดถอยและค่าสหสัมพันธ์ในการหาความสัมพันธ์ระหว่างราคาหุ้นในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับตัวแปรต่าง ๆ. วิทยานิพนธ์ปริญญาโท มหาวิทยาลัย จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

ขวัญชนก ธรรมวิวัฒน์. 2543. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์กับเครื่องชี้เศรษฐกิจมหภาค. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ณัฐพงษ์ พันธเกียรติไพศาล, ดาว ไวรักษ์สัตย์ และอรลดา เผ่าวิบูล. 2548. “ตลาดหลักทรัพย์ mai ขวัญใจนักธุรกิจพันธุ์ใหม่” คัมภีร์เศรษฐกิจ mai 2: 48.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2550. **Presentation.** แหล่งที่มา :

http://www.set.or.th/setresearch/presentation_p1.html (6 สิงหาคม 2550)

ตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ. 2550. การเข้าจดทะเบียนและข้อมูล IPO, การเข้าจดทะเบียน.

แหล่งที่มา : http://www.mai.or.th/th/listing_ipo/listing.html (6 สิงหาคม 2550)

_____. การเข้าจดทะเบียนและข้อมูล IPO, สรุปการเข้าจดทะเบียน. แหล่งที่มา :

<http://www.mai.or.th/mai/listingSummary.do> (6 สิงหาคม 2550)

_____. ข้อมูลซื้อขาย, สถิติภาพรวมตลาด. แหล่งที่มา :

http://www.mai.or.th/th/market_data/market_statistics.html (6 สิงหาคม 2550)

_____. รวบรวมข้อมูลสถิติที่สำคัญและเป็นข้อมูลพื้นฐานในการทำงานวิจัย. แหล่งที่มา :

http://www.set.or.th/setresearch/frs_p1.html (6 สิงหาคม 2550)

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงษ์. 2542. “พฤติกรรมการส่งผ่านราคากุ้งกุลาดำระหว่าง การตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย” วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 3: 46-51.

ธนศักดิ์ ดันตินาคม. 2539. ปัจจัยเชิงเศรษฐศาสตร์ที่มีผลกระทบต่อดัชนีราคาหลักทรัพย์ แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ธีระ เศรษฐเสถียร. 2539. การตัดสินใจลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยของนัก ลงทุนรายย่อยในจังหวัดเชียงใหม่. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

พรพรรณ ไพศาลยกิจ. 2548. ผลกระทบของปัจจัยทางเศรษฐกิจมหภาคต่อดัชนีหลักทรัพย์ กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

รังสรรค์ หทัยเสรี. 2538. “Cointegration and Error Correction Approach : ทางเลือกใหม่ ในการประยุกต์ใช้แบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของประเทศไทย” วารสาร เศรษฐศาสตร์ธรรมศาสตร์ 13: 20-55.

วิภาวี อุบลฉาย. 2546. ปัจจัยทางเศรษฐศาสตร์มหภาคที่มีอิทธิพลต่อดัชนีกลุ่ม 50 หลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

สถลทิพย์ สิริไพบูลย์. 2546. ปัจจัยที่กำหนดดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ระหว่างปี ค.ศ. 1995-2001. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ศิริวรรณ สุคนธ์ปรีช้. 2548. ผลกระทบของการเปลี่ยนแปลงราคาน้ำมันต่อตัวแปรทางเศรษฐกิจ
มหภาคของระบบเศรษฐกิจไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

Dickey, D and Fuller, W.A. 1979. "Distribution of the Estimates for Autoregressive
Time Series with a Unit Root." **American Statistics Association** 74: 427-431.

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

Engle, Robert E. and Granger, Clive W.J. 1987. "Cointegration and Error- Correction:
Representation, Estimation, and Testing." **Econometrica** 55: 251- 276.

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

Gülen, S.G. 1996 "Is OPEC? Evidence from Cointegration and Causality Tests." VOL.
Department of Economics Boston College. 17,2.

Johansen, S. and Juselius, K. 1990. "Maximum Likelihood and Inference on cointegration-with
Applications to Demand for Money." **Oxford Bulletin of Economic Statistics** 52: 169-
210.

Maddala, G.S. and Kim, In-Moo. 1998. **Unit Root Cointegration and Structural Change**.
Cambridge: Cambridge University Press.

Pindyck, Robert S. and Rubinfeld, Daniel L. 1998. **Econometric Models and Economic
Forecasts**. Singapore: McGraw-Hill.