

เอกสารอ้างอิง

- กรณีการ ไซยลังกา. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ธนาคารพาณิชย์ขนาดกลางในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ขวัญชนก ธรรมวิวัฒน์. 2543. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์กับเครื่องชี้เศรษฐกิจมหภาค. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จรินทร์ เทศวานิช. 2523. การพัฒนาเศรษฐกิจ. กรุงเทพฯ: โอเดียนสโตร์.
- ชมเพลิน จันทรเรืองเพ็ญ. 2538. ทฤษฎีและนโยบายการเงิน. กรุงเทพฯ: คณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2548. เครื่องมือเพื่อการวิเคราะห์การลงทุน. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- _____. 2551. รายชื่อบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. แหล่งที่มา : <http://www.set.or.th> (4 มีนาคม 2551)
- _____. 2551. รายชื่อหลักทรัพย์ที่นำมาใช้ในการคำนวณดัชนี SET50 Index สำหรับการคำนวณค่าดัชนีระหว่าง 1 ม.ค.2551 ถึง 30 มิ.ย.2551. แหล่งที่มา : <http://www.set.or.th> (1 มิถุนายน 2551)
- _____. 2550. หลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ใน SET50 Index และ SET100 Index. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- เถลิงศักดิ์ นุชประหาร. 2542. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อการกำหนดอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตี : ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- นภัสสร ณ เชียงใหม่. 2542. ปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีผลต่อการเปลี่ยนแปลงอัตราแลกเปลี่ยนระหว่างเงินบาทกับเงินดอลลาร์สหรัฐในระบบอัตราแลกเปลี่ยนลอยตัวแบบมีการจัดการ. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- นิภาพร สนองบุญ. 2548. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนและดัชนีราคาภายใต้ระบบอัตราแลกเปลี่ยนลอยตัวของประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ยุวดี คันทะมุล. 2548. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- รัตนา เฉลียว. 2549. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลต่อการกำหนดอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ศุภชัยวิจักกรไทย. 2551. “เงินบาทร่วง...อ่อนค่าสุุดรอบ 5 เดือนเทียบกับดอลลาร์ฯ” มงเศรษฐกิจ จ.2193. แหล่งที่มา : <http://www.kasikombank.com> (9 มิถุนายน 2551)
- สุธาสิณี พลอยอุจน์ศรี. 2548. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สุนิสา คำแก้ว. 2549. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างเงินเฟ้อของประเทศไทยกับอัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจ. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สุโลจณี ศรีแก้ว. 2535. การวิเคราะห์หุ้นกลุ่มธนาคารและกลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- หลักทรัพย์เคจีไอ (ประเทศไทย). 2551. บทวิเคราะห์สถานการณ์หุ้นกลุ่มธนาคารปี 2551. แหล่งที่มา : <http://www.kgieworld.co.th> (10 มิถุนายน 2551)
- อลิศรา บุญไชย. 2549. ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงและส่วนต่างของอัตราดอกเบี้ยที่แท้จริง. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อเนก อุปรา. 2547. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มบันเทิงและสันทนาการ โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อารีย์ วิบูลย์พงศ์. 2549. เศรษฐมิติประยุกต์สำหรับการตลาดเกษตร. เชียงใหม่: ภาควิชาเศรษฐศาสตร์เกษตร คณะเกษตรศาสตร์ 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.
- Appleyard, D. R. and Field, A. J. 2001. *International economics*. 4th ed. Singapore: McGraw-Hill.

- Dickey, D.A. and Fuller, W.A. 1981. "Likelihood ratio statistics for autoregressive time series with unit root." **Econometrics** 49: 4 (July) : 1057-1071.
- Dimitrova, Desislava. 2005. "The relationship between exchange rates and stock prices : studied in a multivariate model." **Political Economy The College of Wooster** 14 (August)
- Granger, C.W.J; Huang, B. and Yang, C.W. 2000. "A bivariate causality between stock prices and exchange rates: Evidence form recent asian flu." **The Quarterly Review of Economics and Finance** 40: 337-354.
- Gujarati, Damodar N. 1995. **Basic econometrics**. 3rd ed. New York: McGraw-Hill.
- Mishkin, F. S. 2001. "The transmission mechanism and the role of asset prices in monetary policy." **NBER Working Paper**, No 8617.
- Reuter. **Reuter Kobra 3.5.1**. Avialble : Finance and Investment Center, Chiang Mai University. (June 10, 2008).
- Zietz, J. and Pemberton, D. 1990. "The U.S. budget and trade deficits: A simultaneous equation model." **Southern Economic Journal** 57: 23-34.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
 Copyright© by Chiang Mai University
 All rights reserved