

เอกสารอ้างอิง

กรภัทร์ บุญเรือนยา. 2550. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการใช้นโยบายการคลังและการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

กัลยาณี เจริญกิจหัตถกร. 2547. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์สหรัฐอเมริกา. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

เฉลิมพงษ์ คงเจริญ. 2547. การใช้โปรแกรม EViews ร่วมกับ Gujarati, D. Basic Econometrics. กรุงเทพฯ : คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2553. การแบ่งกลุ่มอุตสาหกรรม และหมวดย่อยของตลาดหลักทรัพย์. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th> (28 มกราคม 2553)

ไทรทศ กลิ่นอุทัย. 2552. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับราคาหลักทรัพย์ของกลุ่มขนส่งและโลจิสติกส์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตี: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

พรอนงค์ บุษราตระกูล. 2547. การลงทุนพื้นฐานและการประยุกต์. กรุงเทพฯ : โรงพิมพ์แห่งจุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

ภัททิรา บำเพ็ญทาน. 2551. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณการซื้อขาย
หลักทรัพย์หมวดธุรกิจการแพทย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกร
ชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาวิทาลัยเชียงใหม่.

สิรินทร คำตันสมบัติ. 2552. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับราคาหลักทรัพย์
ของกลุ่มอสังหาริมทรัพย์และก่อสร้างในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้า
แบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาวิทาลัยเชียงใหม่.

อักรพงศ์ อินทอง. 2550. คู่มือการใช้โปรแกรม EViewsเบื้องต้น: สำหรับการวิเคราะห์ทางเศรษฐมิติ
: เอกสารประกอบการใช้โปรแกรม. เชียงใหม่: สถาบันวิจัยสังคม มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

อุษายา แพทย์เจริญ. 2552. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับดัชนีหมวดธุรกิจ
ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร
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 from 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. Quoted in Dimitrova, Desislava. 2005. "The relationship between exchange rates and stock prices: Studied in a Multivariate model." **Political Economy The College of Wooster** 14 (August)

Mankiw, N. Gregory. 2007. **Principles of macroeconomics**. 4th ed. Mason, OH: Thomson south wester.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved