

เอกสารอ้างอิง

กัลยาณี เจริญกิจหัตถกร. 2548 . **ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์สหรัฐอเมริกา** . การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ขวัญชนก ธรรมวิวัฒน์. 2543. **ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์กับเครื่องชี้เศรษฐกิจมหภาค**. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.2546. **ก้าวแรกสู่การลงทุนในตลาดหลักทรัพย์**. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2547. **ปัจจัยที่เกี่ยวข้องในการลงทุน**. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th.htm> 15 กรกฎาคม 2552.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2547. **รู้จักกับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์**. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

เทิดศักดิ์ ศรีสุรพล และคณะ. 2545. **เศรษฐศาสตร์มหภาค**. กรุงเทพฯ: สถาบันราชภัฏสวนดุสิต.

ธนศักดิ์ ตันตินาคม. 2539 . **ปัจจัยเชิงเศรษฐศาสตร์ที่มีผลกระทบต่อดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์ แห่งประเทศไทย** . การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2552. **ข้อมูลดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ที่สำคัญ** (Nasdaq SET Dow Jones Hang Seng Straits Times และ Nikkei) **รายวัน 1 มกราคม 2550 - 30 สิงหาคม 2552**

เพ็ญศรี จิตต์วัฒนกุล. 2548. **การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณการซื้อขายของหลักทรัพย์กลุ่มเคมีภัณฑ์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

รังสรรค์ หทัยเสรี. 2538. “Cointegration and Error Corection Approach:ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองเศรษฐกิจมหภาคของไทย.” **วารสารเศรษฐศาสตร์ธรรมศาสตร์** 13, (กันยายน): 20-25.

วิชรินทร์ ตันจัญญ . 2547. **ความสัมพันธ์ระหว่างตัวแปรเศรษฐกิจมหภาคกับดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย** . การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์

สลิลทิพย์ ศรีไพบูลย์ .2546. **ปัจจัยที่เป็นตัวกำหนดดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

แหล่งที่มา:<http://www.bot.or.th/Thai/Statistics/EconomicAndFinancial/EconomicIndices/Pages/Index.aspx#> (30 สิงหาคม 2552)

อาภรณ์ ชีวะเกรียงไกร . **สองกล่องเศรษฐกิจ** : กรุงเทพธุรกิจ วันพฤหัสบดีที่ 18 มิถุนายน พ.ศ. 2552

อารยะ ปรีชาเมตตา .**ผลกระทบต่อเศรษฐกิจไทย จากความผันผวนของราคาน้ำมันในตลาดโลก** .การสัมมนาวิชาการประจำปีของคณะเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ ครั้งที่ 31 ประจำปี 2551

Akaike, H. 1969. “ Statistical Predicator Identification.” **Annals of the Institute of Statistical Mathmatics** 21: 203-217.

Ender, W. 1995. **Applied Economic Time Series**. New York: John Wiley & Sons, Inc.

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

Energy information administration . 2552 . **ราคาน้ำมันดิบในตลาดโลก** .แหล่งที่มา
<http://www.eia.doe.gov/>

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. pp776-826,

Gujarati, D.N. **Basic Econometrics**. 3 rd ed. New York: McGraw-Hill, 2003.

Gujarati, D.N. **Basic Econometrics**. 4 th ed. New York: McGraw-Hill, 2003.

Hendry, D.F. and Richard, J.F. "The Econometric Analysis of Economic Time Series. *International of Statistics Review* 51: pp3-33, 1983.

Hsiao, Mei-Cho W. 1998. " Tests of Causality and Exogeneity Between Exports and Economic Growth: The case of Asian NICs." **Journal of Economic Development** 12: 143-159.

Johnson and Dinardo, John. 1997. **Econometric Method**. 4th ed. New York: McGraw-Hill.

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