

บรรณานุกรม

- กนกศักดิ์ ศรีมงคล. การใช้ดัชนีราคาหลักทรัพย์เป็นเครื่องชี้ภาวะเศรษฐกิจไทย. วิทยานิพนธ์
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2543.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. การลงทุน. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2544: 453-467.
- เจน ประสิทธิ์ล้ำค่า. พฤติกรรมการเคลื่อนไหวของราคาหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหา
บัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2526.
- เฉลิมพงษ์ เกตุแก้ว. การพยากรณ์อัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาด
หลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2541.
- เดชวิทย์ นิลวรรณ. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสาร.
การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ธนศักดิ์ คັນดินาคม. ปัจจัยทางเศรษฐศาสตร์ที่มีผลกระทบต่อดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์แห่ง
ประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2539.
- ธนิดา กาญจนพันธ์. ผลกระทบต่อปัจจัยทางเศรษฐกิจต่อราคารู้นของไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐ
ศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2535.
- นารุณียา ยนเปี่ยม. หลักการลงทุน. กรุงเทพฯ: พี.เอ็น.การพิมพ์, 2538.
- นินนาท เจริญเลิศ. ปัจจัยกำหนดการลงทุนในหลักทรัพย์และแนวทางการพัฒนาตลาดหลักทรัพย์
ในอนาคต. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2532.
- บุญชัย เกียรติธนวิทย์. ปัจจัยทางเศรษฐศาสตร์ที่มีผลกระทบต่อราคารู้นกลุ่มธนาคารพาณิชย์และ
กลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรม
ศาสตร์, 2534.
- ผศ.ธีรรัตน์ ภาสกรพิพัฒน์กุล. ความสัมพันธ์ระหว่างราคาขายพาราตลาดส่งมอบทันทีในประเทศไทย
กับราคาขายพาราตลาดล่วงหน้าในต่างประเทศ. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- เพชร ชุมทรัพย์. หลักการลงทุน. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2544.

- รังสรรค์ หทัยเสรี. “Cointegration and Error Correction Approach: ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้แบบจำลองทางเศรษฐศาสตร์มหภาคของไทย” **วารสารเศรษฐศาสตร์ธรรมศาสตร์** 13, 3(กันยายน 2538): 20-51.
- รัตนา สายคณิต. **มหเศรษฐศาสตร์เบื้องต้น(ฉบับปรับปรุงใหม่)**. กรุงเทพฯ: ไทยวัฒนาพานิช, 2541.
- โรจนา ชรรณจินดา. **เอกสารประกอบการเรียนการสอนวิชาการลงทุน**. เชียงใหม่: มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544. (อัดสำเนา).
- สุชาติ อุปริพุทธิพงศ์. **ผลกระทบของปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีต่อดัชนีตราสารหนี้**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2534.
- สุรชัย สุพรประสิทธิ์. “การพิจารณาประกอบการลงทุนหลักทรัพย์ในปี 2541.” **รายงานเศรษฐกิจธนาคารกรุงไทย** 3(มีนาคม 2541): 49.
- _____. “กลยุทธ์การลงทุนในหุ้นปี 2542.” **รายงานเศรษฐกิจธนาคารกรุงไทย** 3(มีนาคม 2542): 47-51.
- _____. “แนวโน้มตลาดหุ้นปี 2545.” **รายงานเศรษฐกิจธนาคารกรุงไทย** 2(กุมภาพันธ์ 2545): 45-48.
- สุโลจน์ ศรีแก้ว. **การวิเคราะห์หุ้นกลุ่มธนาคาร และกลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2535.
- Abdulai, Awuda and Delgado, Christopher L. **An Empirical Investigation of Short and Long run Agriculture Wage Formation in Ghana**. MSSD Discussion Paper No.37 [Online]. Available: <http://www.ifpri.org/divs.mssdp37.html>. December 20, 2002.
- Achsani, Noer Azam. **Stock Market Returns and Macroeconomic Factors: Evidence from Jakarta Stock Exchange of Indonesia 1990-2001**. [Online]. Available: <http://www.pbfea2002.ntu.edu.sg/papers/2076.pdf>. December 13, 2002.
- Anya Khanthavit and Jirat Sungkaew. “The Asset Market View of Thailand’s Stock Price Determination.” เอกสารประกอบการประชุมทางวิชาการเพื่อเสนอผลงานวิจัยชั้นสูงด้านตลาดทุน ครั้งที่ 2 จัดโดยคณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ 20 ธันวาคม 2537. อ้างถึงในจิริตัน สังข์แก้ว. **การลงทุน**. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2544.

- Bulmash B., Trivoli, S. and Trivoli, G. W. "Time-Lagged Interactions Between Stock Prices and Selected Economic Variables." **The Journal of Portfolio Management** (1991): 61-67. Quoted in Koh Tiong Sim and Ramin Cooper Maysami. **A Cointegration Analysis of the Impact of Economic Forces and Global Market Integration on the Singapore Stock Market**. [Online]. Available: http://ntu.edu.sg/nbs/publications/regional_issue_in_economic. December 13, 2002.
- Charemza, Wojciech and Deadman, Derek F. **New Directions in Econometric Practice: General to Specific Modeling, Cointegration and Vector Auto Regression**. Aldershot: Edward Elgar, 1992.
- Fama, E.F., "Stock Returns, Real Activities, Inflation and Money." **American Economic Review** 71(1981): 545-565. Quoted in Achsani, Noer Azam. **Stock Market Returns and Macroeconomic Factors: Evidence from Jakarta Stock Exchange of Indonesia 1990-2001**. [Online]. Available: <http://www.pbfea2002.ntu.edu.sg/papers/2076.pdf>. December 13, 2002.
- Gjerde, O. and Seatterm, F. "Causal Relations Amount Stock Returns and Macroeconomic Variables in a Small, Open Economy." **Journal of International Financial Markets, Institutions and Money** 9(1999): 61-74. Quoted in Noer Azam Achsani. **Stock Market Returns and Macroeconomic Factors: Evidence from Jakarta Stock Exchange of Indonesia 1990-2001**. [Online]. Available: <http://www.pbfea2002.ntu.edu.sg/papers/2076.pdf>. December 13, 2002.
- Johansen, S. and Juselius, K. "Maximum Likelihood Estimate and Inference on Cointegration with Applications to the Demand for Money." **Oxford Bulletin of Economics and statistics** 52(1990).
- Johnston, J. and Dinardo, J. **Econometric Methods**. Singapore: McGraw-Hill, 1997.
- Koh, Tiong Sim and Maysami, Ramin Cooper. **A Cointegration Analysis of the Impact of Economic Forces and Global Market Integration on the Singapore Stock Market**. [Online]. Available: http://ntu.edu.sg/nbs/publications/regional_issue_in_economic. December 13, 2002.

- Lee, B.S. "Causal Relation Amount Stock Returns, Interest Rates, Real Activity, and Inflation." **Journal of Finance** 47(1992): 1591-1603. Quoted in Noer Azam Achsani. **Stock Market Returns and Macroeconomic Factors: Evidence from Jacata Stock Exchange of Indonesia 1990-2001**. [Online]. Available: <http://www.pbfea2002.ntu.edu.sg/papers/2076.pdf>. December 13, 2002.
- Mukherjee, D. and A. Naka. "Dynamic Relations Between Macroeconomic Variables and the Japanese Stock Market: An Application of a Vector Error Correction Model." **Journal of Finance Research**, 18(1995): 223-237. Quoted in Noer Azam Achsani. **Stock Market Returns and Macroeconomic Factors: Evidence from Jakarta Stock Exchange of Indonesia 1990-2001**. [Online]. Available: <http://www.pbfea2002.ntu.edu.sg/papers/2076.pdf>. December 13, 2002.
- Reuters. **Reuters kobra 3.5.1**. [Online]. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. December 13, 2002.
- Supawat Rungsuriyawiboon. "Estimating Residential Demand for Electricity in the United States." **วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่** 6, 2(พฤษภาคม – สิงหาคม 2545): 91-104.
- Teh, K. P. and Shanmugaratnam, T. "ExchangeRate Policy: Philosophy and Conduct Over the past Decade." **Public Policies in Singapore: Changes in the 1980s and Future Signposts**. N.P.: Times Academic Press. 1992. Quoted in Koh Tiong Sim and Ramin Cooper Maysami. **A Cointegration Analysis of the Impact of Economic Forces and Global Market Integration on the Singapore Stock Market**. [Online]. Available: http://ntu.edu.sg/nbs/publications/regional_issue_in_economic. December 13, 2002.
-