บรรณานุกรม

ภาษาไทย

กัญสุดา ลิ้มพิพัฒน์ชัย. 2544. **แบบจำลองเชิงเศรษฐมิติสำหรับภาคการผลิต ตลาดแรงงาน และระดับราคาของประเทศไทย.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

กนกทิพย์ พัฒนาพัวพันธ์. 2543. **สถิติอ้างอิงเพื่อการวิจัยทางการศึกษา.** คณะศึกษาศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

กรรณิการ์ ลิปตพัลลภ. 2534. **การธนาคารพาณิชย์.** ภาควิชาบริหารธุรกิจ คณะเศรษฐศาสตร์และบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์.

เฉลิมพงษ์ เกตุแก้ว. 2541. **การพยากรณ์อัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสสรณ์กุล. 2544. **แบบจำลองเศรษฐมิติสำหรับภาครัฐบาลของประเทศไทย.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2546. **Financial Statement.** [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: http://www.settrade.com

ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2546. **ข้อมูลเศรษฐกิจ.** [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: http://www.bot.or.th/bothomepage/databank/Econdata/Econdata.htm

ธนิดา กาญจนพันธ์. 2535. **ผลกระทบของปัจจัยทางเศรษฐกิจต่อราคาหุ้นของไทย.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

บุญชัย เกียรติธนาวิทย์. 2534. **ปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีอิทธิพลต่อราคาหุ้นกลุ่มธนาคารพาณิชย์และบริษัทเงินทุนและหลักทรัพย์.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

บุญศรี ตรีหิรัญกุล. 2539. **ปัจจัยที่มีผลกระทบต่ออัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในหลักทรัพย์.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

วิโชติ ตั้งศักดาพร. 2540. **การปรับตัวของอัตราดอกเบี้ยระยะสั้นในประเทศไทย.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

วิทยากร เชียงกูล และคณะ. 2541. **วิกฤติเศรษฐกิจไทย ผลกระทบจากการรับเงื่อนไข IMF และทางออกสำหรับประชาชน.** กรุงเทพฯ: สำนักงานกองทุนสนับสนุนการวิจัย.

วิภาวี อุบลฉาย. 2546. **ปัจจัยทางเศรษฐศาสตร์มหภาคที่มีอิทธิพลต่อดัชนีกลุ่ม 50 หลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

วัชรี พฤกษิกานนท์. 2528. **สถิติเศรษฐศาสตร์.** คณะสังคมศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

วเรศ อุปปาติก. 2541. **เศรษฐศาสตร์การเงินและการธนาคาร.** กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

สุนทรี กัลชาญพิเศษ. 2539. **การตัดสินใจลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยใช้แบบจำลอง Arbitrage Pricing Theory (APT).** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ภาษาอังกฤษ

Bhanupongse Nidhiprabha. 1984. **External Shocks and Adjustment Policies in Thailand.** Ph.D Dissertation, Johns Hopkins University.

Charemza, Wojciech and Deadman, Derek F. 1992. **New Directions in Econometric Practice: General to Specific Modeling, Cointegration and Vector Autoregressive.** Aldershot: Edward Elgar.

Chow, E., Lee, W. and Solt, M., 1997. "The Exchange-rate Risk Exposure of Asset Returns." **Journal of Business** 70: 105-123.

Dicky, David A. and Fuller, Waynes. 1981. "Likelihood Ratio Statistics For Autoregressive Time Series with Unit Root." **Econometrica** 49 (July):1052-1072.

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

Engle, Robert F. and Granger, C.W.J. 1987. "Co-integration and Error Correction : Representation, Estimating and Testing." **Econometrica** 55, 2 (March): 251–276.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

Engle, Robert F. and Granger, C.W.J. 1991. **Long-Run Economic Relationships: Reading in Cointegration.** New York: Oxford University Press.

Evans, G.B.A. and Sann, N.E. 1981. "Testing of Unit Roots : 1." **Econemetrica** 49 (May): 753-779.

Gujarati, Damodar N. 1995. **Basic Econometrics**. New York: McGraw –Hill.

Hargreaves, Colin P. 1994. **Nonstationary Time Series Analysis and Cointegration.** New York: Oxford University Press.

Harris, R.I.D. 1995. **Using Cointegration Analysis in Econometric Modeling.** Great Britain: T.J.Press (Padstow).

Hendry, David F. 1994. **Co-integration, Error Correction, and The Econometric Analysis of Non-Stationary Data.** New York: Oxford University Press.

Hjelm, Goran and McGinty, Matthew. 2001. **Can We Use the Johansen Cointegration Approach to Forecast Monetary Models of the Nominal Exchange Rate?.** Lund: Department of Economics, Lund University.

Ihrig, Jane. 2001. **Exchange- Rate Exposure of Multinationals: Focusing on Exchange-Rate Issues. International Finance Discussion Papers** 709. Washington, DC: Board of Governors of the Federal Reserve System.

Johansen, S. 1991. "Estimation and Hyphothesis Testing of Cointegration Vectors in Gaussian Vector Autoregressive Models." **Econometrica** 59, 6 (November): 1557–1580.

Johansen, Soren and Katerina Juselius. 1990. "Maximum Likelihood Estimation and Inference on Cointegration with Application to the Demand for Money." **Oxford Bulletin of Economics and Statistics** 52: 169-209.

Johnston, J. and Dinardo, J. 1997. **Econometric Methods.** Singapore: McGraw-Hill.

Kennedy, P. 1995. **A Guide to Econometrics.** Cambridge, MA: The MIT Press.

Klinhowhan, Ubonrat. 1999. **Monetary Transmission Mechanism in Thailand.** Master's thesis (English Language Program) Thammasat University.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

Koh, Tiong Sim and Maysami, Ramin Cooper. 2002. **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.

Morley, Bruce. 2003. **Equities and the Monetary Model of the Exchange Rate: An ARDL Bounds Testing Approach. SMBA Research Paper.** [Online]. Available: http://www.aber.ac.uk/smba/english_ver/research/rsp2003.shtml. 23 September 2003.

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

Rensselaer, Kristen N.Van and Copeland, Joe B. 2000. 'Saving and Investment Rates in Latin America: An Error Correction Analysis." **Journal of Economics and Finance** 24, 2:195-205.

Ramirez, Miguel D. and Khan, Shahryar. 1999. "A Cointegration Analysis of Purchasing Power Parity: 1973-96." **International Advances in Economic Research** 5, 3 (August): 369-385.

Supawat Rungsuriyawiboon. 2545. "Estimating Residential demand for Electricity in the United States." **วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่** 6, 2 (พฤษภาคม-สิงหาคม): 91-104.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved