

เอกสารอ้างอิง

ภาษาไทย

- จรินทร์ เทศวานิช. 2542. **เงิน ตลาดการเงิน และสถาบันการเงิน**. กรุงเทพฯ: ซีเอ็ดดูเคชั่น.
- ชนินทร์ พิทยาวิวิธ. 2534. **ตลาดการเงินในประเทศไทย**. กรุงเทพฯ: อมรินทร์ พรินต์ติ้ง กรุ๊ป.
- ฐาปนา ฉิ่งไพศาล. 2543. **การเงินระหว่างประเทศ**. กรุงเทพฯ: ซีระฟิล์มและไซเท็กซ์.
- ชนศักดิ์ ตันตินาคม. 2539. **ปัจจัยเชิงเศรษฐศาสตร์ที่มีผลกระทบต่อดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- นฤมล เชาว์วิฑูยางกุล. 2542. **ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนในตลาดแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศกับตลาดหลักทรัพย์**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- บุญยง ทิพย์โส. 2524. **มห-เศรษฐศาสตร์**. กรุงเทพฯ: จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- เบญจวรรณ จันทรา. 2546. **ผลกระทบของข้อจำกัดทางด้านสภาพคล่อง และการผ่อนคลายทางการเงินต่อพฤติกรรมกรรมการบริโภคนภาคเอกชนในประเทศไทย**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ประเจิด สิ้นทรัพย์. 2527. **เศรษฐศาสตร์มหภาคเบื้องต้น**. กรุงเทพฯ: ไทยวัฒนาพานิช.
- พัชรี ชุมทรัพย์. 2540. **หลักการลงทุน**. กรุงเทพฯ: มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- รังสรรค์ หทัยเสรี. **Cointegration and Error Correction Approach : ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของประเทศไทย**. วารสารเศรษฐศาสตร์
ธรรมศาสตร์, 13 (กันยายน 2538): 20-55.
- ลลิตาพรรณ โพธิโกสุม. 2546. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นบางหุ้นในกลุ่มบันเทิงและสันทนาการโดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วิจักขณ์ ศิริเสรี. 2540. **การบริหารความเสี่ยงทางอัตราแลกเปลี่ยนภายใต้ระบบลอยตัว**. กรุงเทพฯ
: ไอโอนิก อินเตอร์เทค รีซอสเซส.

- วิสุมิตรา วงศ์เลี้ยงถาวร. 2546. **การวิเคราะห์ความเสถียรของหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้วิธีโคอินทิเกรชันและเรอร์คอร์เรชัน**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วันรัช มิ่งมณีนาคิน. 2517. **เศรษฐศาสตร์ระหว่างประเทศ**. กรุงเทพฯ: มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ศรีวงศ์ สุมิตร และ สาลินี วรบัณฑิต. 2536. **เศรษฐศาสตร์ระหว่างประเทศ**. พิมพ์ครั้งที่ 2. กรุงเทพฯ: จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- อารีย์ เชื้อเมืองพาน. 2545. **การวิเคราะห์ทางการเงินในตลาดการเงิน**. เชียงใหม่: นพบุรีการพิมพ์.
- อัครา วงศ์วิจิตร. 2546. **การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจและการส่งออกของประเทศไทย อินโดนีเซีย มาเลเซีย และเกาหลีใต้**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ภาษาอังกฤษ

- Aggarwal, R. 1981. "Exchange Rate and Stock Price Interactions in Emerging Financial Market: Evidence on India, Korea, Pakistan, and Philippines." **Applied Financial Economics** 7: 25-35.
- Bhattacharya, Basabi and Mukherjee, Jaydeep . 2002. "Causal Relationship Between Stock Market and Exchange Rate, Foreign Exchange Reserves and Value of Trade Balance: A Case Study For India." **The Quarterly Review of Economics and Finance** 45: 395-411. Available:<http://www.north-holland.com> September 12, 2003.
- Chung, S. Kwon and Tai, S. Shin. 1999. "Cointegration and Causality Between Macroeconomic Variables and Stock Market Returns." **Global Finance Journal** 10, 1 : 71-81. Available:<http://www.yahoo.com> September 12, 2003.
- Dickey, David D. and Fuller, Wayne A. 1981. "Likelihood Ratio Statisticals for Autoregressive Time Series with a Unit Root." **Econometrica** 49, 4 (July) : 1057-1072.
- Enders, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series** New York : John Wiley & Sons.
- Engle, Robert F. and Granger, C. W. J. 1987. "Cointegration and Error Correction : Representation, Estimation, and Testing." **Econometrica** 55, 2(March) : 251-276.
- Granger, Clive W.J. ; Huang, Bwo-Nung and Yang, Chin-Wei . 2000. "A Bivariate Causality

- Granger, Clive W.J. ; Huang, Bwo- Nung and Yang, Chin-Wei . 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.
Available:<http://www.north-holland.com> September 15, 2003.
- Gujarati, Damodar N. 1995. **Basic Econometrics**. New York: McGraw-Hill.
- Johnston, Jack and Dinardo, John. 1997. **Econometric Methods**. 4th ed. Singapore : McGraw-Hill.
- Kim, Ki-Ho . 2003. "Dollar Exchange Rate and Stock Price: Evidence from Multivariate Cointegration and Error Correction Model." **Review of Finance Economics** 12: 301-313. Available:<http://www.yahoo.com> September 12, 2003.
- Krueger, A. O. 1983. **Exchange-Rate Determination**. Cambridge: Cambridge University Press.
- Muhammad, Naeem and Rasheed Abdul. 2000. "Stock Prices and Exchange Rates: Are they Related? Evidence from South Asian Countries. **Japan and the World Economy** 10 :468-476. Available: <http://elsevier.com/locate/econbase>. October 3, 2003.
- Nieh, Chien-Chung and Nieh, Cheng-Few. 2001. "Dynamic Relationship Between Stock Prices and Exchange Rates for G-7 Countries." **The Quarterly Review of Economics and Finance** 41: 477-490. Available: <http://www.yahoo.com> September 12, 2003.
- Nishat, Mohammed and Mustafa, Khalid . 2000. "Exchange Rate and Stock Prices Relationship: An Empirical Evidence from Pakistani Financial Markets." **Review of Finance Economics** 11 : 356-368. Available:<http://www.yahoo.com> September 12, 2003.
- Pan, Ming-Shiun ; Fok, Chi-Wing Robert and Liu, Y. Angela. 2001. " Dynamic Linkages Between Exchange Rates and Stock Prices: Evidence from Pacific Rim Countries." **Global Finance Journal** 9,3: 83-82. Available:<http://www.yahoo.com> September 12, 2003.
- Phylaktis, Kate and Ravazzolo, Fabiola . 2000. "Stock Prices and Exchange Rate Dynamics." **Japan and the World Economy** 12 :326-338. Available: <http://elsevier.com/locate/econbase> October 3, 2003.
- Pindyck, Robert S. and Rubinfeld, Daniel L. 1998. **Econometric Models and Economic Forecast**. 4th ed. Boston, MA. : McGraw-Hill.

June, Nualtaranee. 1992. **Household Consumption and Saving : Random Walk Hypothesis.**

Master's Economics, Thammasat University.

Pindyck, Robert S. and Rubinfeld, Daniel L. 1998. **Econometric Models and Economic**

Forecasts. Singapore: McGraw-Hill.

Reuters. 2001. **Reuters Kober 3.5.1.** Available : Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 13 October 2003.

Zubaidi, Baharumshah Ahmad; M. Masih, A. Mansur and Azali M . 2002. "The Stock Market and Ringgit Exchange Rate : A Note." **Japan and the World Economy** 14 :471-486 . Available: <http://elsevier.com/locate/econbase> October 3, 2003.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved