

เอกสารอ้างอิง

- กิตติ ศิริพัลลภ. 2521. การใช้สมการถดถอยและค่าสหสัมพันธ์ในการหาความสัมพันธ์ระหว่างราคาหุ้นในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับตัวแปรต่าง ๆ. วิทยานิพนธ์ปริญญาโท มหาวิทยาลัย จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2545. เศรษฐมิตติ : เอกสารประกอบการสอน. เชียงใหม่ : คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ [อค์สำเนา]
- ทมากรณ์ กองแก้ว. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ ขนาดใหญ่ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยใช้วิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- นินนาท เจริญเลิศ. 2546. ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อดัชนีของหุ้นในกลุ่มก่อสร้างและวัสดุก่อสร้างในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- บุญญธนิศวรรค์ ชมพุกำ. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์บริษัทผลิตไฟฟ้าบางหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้วิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปาริชาติ โภชนจันทร์. 2547. การวิเคราะห์การลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยตามทฤษฎีการกำหนดราคาแบบเอพีทีโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- พัชรา ดันันวิจิตร. 2548. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณหลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุก่อสร้างและตกแต่งของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยใช้วิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เมธินี รัศวีวิจิตรไพศาล. 2530. ความสัมพันธ์ระหว่างปริมาณเงินกับราคาหลักทรัพย์ในประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิตจุฬาลงกรณ์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

ยุวดี คันทะมุล. 2548. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณของหลักทรัพย์ กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

วรวิทย์ พรพิมลมิตร. 2542. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างการเจริญเติบโตของการส่งออกกับการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจ กรณีศึกษากลุ่มอาเซียน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

วิสุมิตรา วงศ์เต็มดาว. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนา อสังหาริมทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยใช้วิธีโคอินทิเกรชันและเอเรอร์คอร์เรคชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

สุธาณี พลอยอรุณศรี. 2548. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์ในกลุ่มสื่อสารของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

สำนักงานนโยบายและแผนพลังงาน. 2548. ข้อมูลพลังงาน. แหล่งที่มา :

<http://www.eppo.go.th/index-T.html>. 12 กันยายน 2549.

สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง. 2549 . ราคาทองคำความเปลี่ยนแปลงทางปัจจัยพื้นฐาน. แหล่งที่มา :

<http://www.fpo.go.th/content.php?action=view§ion=3100000000&id=5094>. 29

พฤษภาคม 2549.

อัชฌรา วงศ์วิจิตร. 2546. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจและการส่งออกของไทย อินโดนีเซีย มาเลเซีย เกาหลีใต้. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

Dickey, D and Fuller, W.A. 1997. "Distribution of the Estimators for Autoregressive Time Series with a Unit Root." *American Statistics Association* 74 : 427-431.

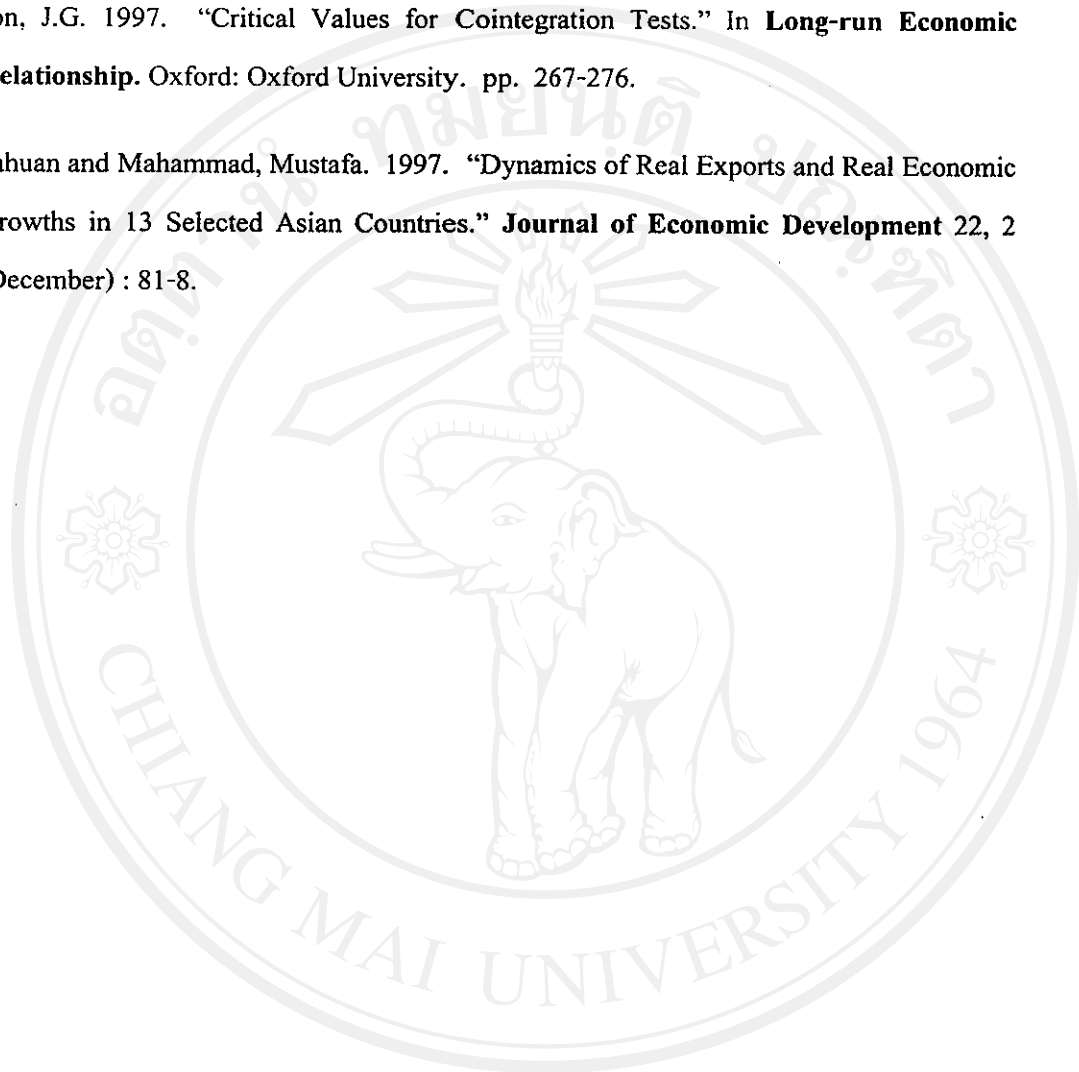
Enders, Walter. 1995. *Applied Econometric Time Series*. New York : John Wiley & Sons.

Engle, Robert E and Granger, Clive W.J. 1987. "Cointegration and Error-Correction : Representation, Estimation, and Testing." *Econometrica* 55 (March) : 251-276

Johnston, Jack and Dinardo, John. 1997. **Econometric Methods** . 4thed. New York : Mc Graw Hill.

MacKinnon, J.G. 1997. "Critical Values for Cointegration Tests." In **Long-run Economic Relationship**. Oxford: Oxford University. pp. 267-276.

Matiur, Rahuan and Mahammad, Mustafa. 1997. "Dynamics of Real Exports and Real Economic Growths in 13 Selected Asian Countries." **Journal of Economic Development** 22, 2 (December) : 81-8.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved