

## เอกสารอ้างอิง

- กัลยาณี เจริญกิจหัตถกร. 2548. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้่นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับดัชนีราคาหุ้่นตลาดหลักทรัพย์สหรัฐอเมริกา. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ขวัญชนก ธรรมวิวัฒน์. 2543. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้่นตลาดหลักทรัพย์กับเครื่องชี้เศรษฐกิจมหภาค. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ธนศักดิ์ ต้นดินาคม. 2539. ปัจจัยเชิงเศรษฐศาสตร์ที่มีผลกระทบต่อดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ธนิดา กาญจนพันธ์. 2534. ผลกระทบของปัจจัยทางเศรษฐกิจต่อราคาหุ้่นไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- นินนาท เจริญเลิศ. 2532. ปัจจัยกำหนดการลงทุนในหลักทรัพย์และแนวทางการพัฒนาตลาดหลักทรัพย์ในอนาคต. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- นลินี โอภาสชาลิต. 2548. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้่นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับดัชนีราคาหุ้่นตลาดหลักทรัพย์ในสหภาพยุโรป. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตติ : ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เบ็ญจวรรณ ไชยยันต์. 2539. การลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยในจังหวัดเชียงใหม่. วิทยานิพนธ์บริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- พริ้มรวี สมงาม. 2546. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้่นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับดัชนีราคาหุ้่นตลาดหลักทรัพย์ในภูมิภาคเอเชีย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

รังสรรค์ หทัยเสรี. 2538. “Cointegration and Error Correction Approach ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของไทย.” **วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์** 13 (กันยายน): 20 – 55.

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

Engle, R., and Granger, Clive W. 1987. "Cointegration and Error - Correction Representation, Estimation, and Testing." **Econometrica** 55: 391-407.

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

Johansen, S. and Juselius, K. 1990. “Maximum Likelihood and Inference on Cointegration with Applications to the Demand for Money.” **Oxford Bulletin Economics and Statistics**. 52: 169-210.

Johnston, J. and Dinaedo, J. 1997. **Econometric Methods**. 4<sup>th</sup> ed. New York: McGraw – Hill.

Pindyck, R.S and Rubinfeld, D.L. 1998. **Econometric Models and Economic Forecasts**. 4<sup>th</sup> ed. New York: McGraw – Hill.

Reuters. **Reuters Kobra 3.5.1**. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. (12 January 2007)