

เอกสารอ้างอิง

- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2552. รายชื่อบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์.
แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th> (16 กุมภาพันธ์ 2552)
- _____. 2552. รายชื่อหลักทรัพย์ที่นำมาใช้ในการคำนวณดัชนี SET50 Index สำหรับการคำนวณ
ค่าดัชนีระหว่าง 1 มกราคม 2552 ถึง 30 มิถุนายน 2552. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th>
(15 กุมภาพันธ์ 2552)
- _____. 2552. รายชื่อหลักทรัพย์ที่นำมาใช้ในการคำนวณดัชนี SET100 Index สำหรับการ
คำนวณค่าดัชนีระหว่าง 1 มกราคม 2552 ถึง 30 มิถุนายน 2552. แหล่งที่มา:
<http://www.set.or.th> (15 กุมภาพันธ์ 2552)
- _____. 2552. หลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ใน SET50 Index และ SET100 Index.
แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th> (15 กุมภาพันธ์ 2552)
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิติ : ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: เศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. ดัชนีชี้นำเศรษฐกิจและองค์ประกอบที่ปรับฤดูกาล. แหล่งที่มา:
<http://www.bot.or.th> (16 กุมภาพันธ์ 2552)
- _____. สถิติอัตราแลกเปลี่ยนย้อนหลัง. แหล่งที่มา: <http://www.bot.or.th>
(16 กุมภาพันธ์ 2552)
- นิยม รัฐอมฤต. 2551. วิกฤตต้มยำกุ้ง. แหล่งที่มา: <http://www.thaipoliticsgovernment.org>
(11 กุมภาพันธ์ 2552)
- ไพฑูรย์ ไกรพรศักดิ์. 2548. เศรษฐมิติเบื้องต้น. พิมพ์ครั้งที่ 2. กรุงเทพฯ: คณะเศรษฐศาสตร์
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- รุจกร ผลเพิ่ม. 2549. ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราดอกเบี้ยกับดัชนีราคาหลักทรัพย์หมวด
อุตสาหกรรมของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วิภาวี อุบลฉาย. 2546. ปัจจัยทางเศรษฐศาสตร์มหภาคที่มีอิทธิพลต่อดัชนีกลุ่ม 50 หลักทรัพย์ของ
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

- ศิริรัตน์ ใจสมิง. 2550. ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อดัชนีตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ศูนย์วิจัยกสิกรไทย. 2551. วิฤตการณ์ทางการเงินสหรัฐฯ และทิศทางของเงินทุนต่างชาติ ผลต่อธุรกิจอสังหาริมทรัพย์ไทย. แหล่งที่มา: <http://www.kasikornbank.com> (10 ตุลาคม 2551)
- _____. 2551. วิฤตแฮมเบอร์เกอร์และวิฤตต้มยำกุ้ง ผลกระทบที่แตกต่าง. แหล่งที่มา: <http://www.kasikornbank.com> (17 ตุลาคม 2551)
- สายสุดา จันทรา. 2547. ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศกับดัชนีหลักทรัพย์บางประเทศในเอเชีย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง. 2548. ความไม่สมดุลระหว่างประเทศ. แหล่งที่มา: <http://www.scb.co.th/LIB/th/article/mof/mof4803-1.html> (20 กุมภาพันธ์ 2552)
- ห้องสมุดออนไลน์ my first info. 2552. ศัพท์ธุรกิจ. แหล่งที่มา: <http://finance.myfirstinfo.com> (9 พฤษภาคม 2552)
- อักรพงศ์ อ้นทอง. 2546. คู่มือการใช้โปรแกรม Eviews เพื่อการวิเคราะห์ Unit Root, Cointegration และ Error Correction Model (ตามวิธีการของ Engle and Granger). เชียงใหม่: สถาบันวิจัยสังคม มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เอกนิตินิติทัศน์ประภาสและปิยศักดิ์ มานะสันต์. “วิฤตการณ์การเงินโลก: สาเหตุผลกระทบและความเสี่ยงต่อเศรษฐกิจไทย.” วารสารธนาคารอาคารสงเคราะห์ 55 (ตุลาคม-ธันวาคม 2551): 21-27.
- Abdalla and Murinde. 1997. “Exchange Rate and Stock Price Interactions in Emerging Financial Markets: Evidence on India, Korea, Pakistan and Philippines.” **Applied Financial Economics** 7: 25-35. Quoted in Bhattacharya Basibi 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.** Kalkata: Jadavpur University.
- Abdelaziz, M; Chortareas, G. and Cipollini, A. 2008. **Stock prices, exchange rates, and oil: Evidence from Middle East Oil-exporting Countries.** Colchester: University of Essex.
- Aggarwal, R. 1981. “Exchange Rates and Stock Prices: A Study of the US Capital Markets Under Floating Exchange Rates.” **Akron Business and Economic Review** 12: 7-12.

Quoted in Bhattacharya Basibi 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.** Kalkata: Jadavpur University.

Ajayi, R. A. and Mougoue, M. 1996. "On the dynamic relation between stock prices and exchange rates." **The Journal of Financial Research** 19: 193-207.

Appleyard, D. R. and Field, A. J. 2001. **International economics.** 4th ed. Singapore: McGraw-Hill.

Bahmani-Oskooee, M and Sohrabian, A. 1992. "Stock prices and the effective exchange rate of the dollar." **Applied Economics** 24: 459-464. Quoted in Bhattacharya Basibi 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.** Kalkata: Jadavpur University.

Bhattacharya Basibi 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.** Kalkata: Jadavpur University.

Dimitrova, Desislava. 2005. "The Relationship Between Exchange Rates and Stock Prices : Studied in a Multivariate Model." **Political Economy the College of Wooster** 14 (August)

Doong, S; Yang, S. and Wang, A. 2005. "The dynamic relationship and pricing of stock and exchange rate: Empirical evidence from Asian emerging markets." **The Journal of American Academy of Business.** Cambridge 7, 1: 118-123. Quoted in Abdelaziz, M;

Chortareas, G. and Cipollini, A. 2008. **Stock prices, exchange rates, and oil: Evidence from middle east oil-exporting countries.** Colchester: University of Essex.

Enders, Walter. 1995. **Applied econometric time series.** New York: John Wiley&Son.

Huang, B; Granger, C. and Yang, C. 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. Quoted in Abdelaziz, M; Chortareas, G. and Cipollini, A. 2008. **Stock prices, exchange rates, and oil: Evidence from middle east oil-exporting countries.** Colchester: University of Essex.

Ito, T. and Yuko, H. 2004. **High-frequency contagion between the exchange rates and stock**

prices. Working paper 10448. NBER, Cambridge; MA. Quoted in Abdelaziz, M; Chortareas, G. and Cipollini, A. 2008. **Stock prices, exchange rates, and oil: Evidence from middle east oil-exporting countries.** Colchester: University of Essex.

Khalid, M. and Kawai, M. 2003. "Was financial market contagion the source of economic crisis in Asia?: Evidence using multivariate VAR model." **Journal of Asian Economics** 14: 131-156. Quoted in Abdelaziz, M; Chortareas, G. and Cipollini, A. 2008. **Stock prices, exchange rates, and oil: Evidence from middle east oil-exporting countries.** Colchester: University of Essex.

Mishkin, F. S. 2001. **The transmission mechanism and the role of asset prices in monetary policy.** Working paper 8617. NBER, Cambridge; MA.

Zietz, J. and Pemberton, D. 1990. "The U.S. budget and trade deficits: A simultaneous equation model." **Southern Economic Journal** 57: 23-34.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved