

เอกสารอ้างอิง

- กมลวรรณ กิตติพัฒน์วิทย์. 2548. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณหลักทรัพย์
ในกลุ่มขนส่งของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบ
อิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- กรมเจรจาการค้าระหว่างประเทศ. 2552. ลำดับประเทศคู่ค้า. แหล่งที่มา: <http://www.dtn.go.th>
(มกราคม 2552)
- กัลยาณี เจริญกิจหัตถกร. 2548. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์สหรัฐอเมริกา. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ขวัญชนก ธรรมวิวัฒน์. 2543. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์กับเครื่องชี้
เศรษฐกิจมหภาค. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จินตนันท์ ชันไชย. 2550. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่ง
ประเทศไทยกับเงินสำรองระหว่างประเทศของประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- “ดอลลาร์-ทุนไหลออก-การเมือง แกว่ง “ค่าบาท” ปี 2552.” 2552. ฐานเศรษฐกิจ (1 มกราคม).
แหล่งที่มา: <http://www.thannews.th.com> (1 มกราคม 2552)
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2551. รายชื่อบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่ง
ประเทศไทย. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th> (พฤศจิกายน 2551)
- _____. 2551. รายชื่อหลักทรัพย์ที่นำมาใช้ในการคำนวณดัชนี Set 50 Index. แหล่งที่มา:
<http://www.set.or.th> (ธันวาคม 2551)
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตี: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ชนศักดิ์ ต้นดินนาคม. 2539. ปัจจัยทางเศรษฐศาสตร์ที่มีผลกระทบต่อดัชนีราคาหลักทรัพย์แห่ง
ประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2551. ข้อมูลการลงทุนของนักลงทุนต่างชาติในตลาดหลักทรัพย์ไทย.
แหล่งที่มา: <http://www.bot.or.th> (ธันวาคม 2551)

_____. 2551. สถิติอัตราแลกเปลี่ยนย้อนหลัง. แหล่งที่มา: <http://www.bot.or.th>
(ธันวาคม 2551)

นิภาพร สนองบุญ. 2548. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนและดัชนีราคาภายใต้ระบบอัตราแลกเปลี่ยนลอยตัวของประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

บุพพวรรณ วุฒิชัยวงศ์. 2551. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับราคาหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ปิยะลักษณ์ พุทธวงศ์. 2551. เศรษฐมิตติ: เอกสารประกอบการสอน. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

พรทิพย์ เขียวศรีวิทย์. 2551. การเงินการธนาคาร. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

“สถานการณ์ค่าเงินบาท.” 2552. ฐานเศรษฐกิจ (22 มกราคม 2552). แหล่งที่มา: <http://www.thannews.th.com/detailnews> (22 มกราคม 2552)

สายสุดา จันทรา. 2547. ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศกับดัชนีตลาดหลักทรัพย์บางประเทศของเอเชีย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

สุโลจน์ ศรีแก้ว. 2535. การวิเคราะห์หุ้นกลุ่มธนาคารและกลุ่มเงินทุนหลักทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

หลักทรัพย์กิมเอ็ง(ประเทศไทย). สถิติราคาหุ้น. แหล่งที่มา: <http://www.kimeng.co.th>
(มกราคม 2552)

อักรพงศ์ อ้นทอง. 2546. คู่มือการใช้โปรแกรม EViews เพื่อการวิเคราะห์ Unit Root, Cointegration และ Error Correction Model (ตามวิธีการของ Engle and Granger). เชียงใหม่: สถาบันวิจัยสังคม มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

เอกนิติ นิติทัณฑ์ประภาศ และ ปิยศักดิ์ มานะสันต์. 2551. “วิกฤตการณ์การเงินโลก : สาเหตุผลกระทบและความเสี่ยงต่อเศรษฐกิจไทย.” วารสารธนาคารอาคารสงเคราะห์ 55 (ตุลาคม-ธันวาคม): 21-27.

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.
- Dickey, D.A. and Fuller, W.A. 1981. “Likelihood ratio statistics for autoregressive time series with unit root.” **Econometrics** 49, 4 (July): 1057-1071.
- Dimitrova, Desislava. 2005. “The relationship between exchange rates and stock prices: Studied in a Multivariate model.” **Political Economy The College of Wooster** 14 (August)
- Granger, C.W.J; Huang, B. and Yang, C.W. 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.
- Gujarati, Damodar N. 1995. **Basic econometrics**. 3rd ed. New York: McGraw-Hill. Quoted in Dimitrova, Desislava. 2005. “The relationship between exchange rates and stock prices: Studied in a Multivariate model.” **Political Economy The College of Wooster** 14 (August)
- Krueger, A. O. 1983. **Exchange-rate determination**. Cambridge: Cambridge University.
- Mankiw, N. Gregory. 2007. **Principles of macroeconomics**. 4th ed. Mason, OH: Thomson south wester.
- Mishkin, F. S. 2001. “The transmission mechanism and the role of asset prices in Monetary policy.” **NBER Working Paper** No 8617.
- Zietz, J. and Pemberton, D. 1990. “The U.S. budget and trade deficits: A simultaneous equation model.” **Southern Economic Journal** 57: 23-34.