

เอกสารอ้างอิง

- กาญจนา ลังกาวงค์. 2551. ความสัมพันธ์ระหว่างการออมและการลงทุนของประเทศในภูมิภาคเอเชีย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จรินทร์ เทศวานิช. 2542. เงินตลาดเงินและสถาบันการเงิน. กรุงเทพฯ: ซีเอ็ดดูเคชั่น
- ถวิล นิลใบ. 2551. “ซบไฟร์ม.” [ระบบออนไลน์]. แหล่งที่มา <http://www.eco.ru.ac.th> (9 พฤษภาคม 2553)
- บุพพวรรณ วุฒิชัยวงศ์. 2551. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับราคาหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วันวิสา วิโรจนารมย์. 2551. การประมาณอุปสงค์การท่องเที่ยวของนักท่องเที่ยวต่างชาติในประเทศไทย โดยใช้ข้อมูลพาแนลแบบไม่นิ่ง. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วิกิพีเดีย. 2553. “กลุ่มประเทศ G 20.” [ระบบออนไลน์]. แหล่งที่มา <http://th.wikipedia.org/wiki/> (9 พฤษภาคม 2553)
- ศราวุธ ทองอร่าม. 2551. ผลกระทบของซบไฟร์มต่อเศรษฐกิจไทย. สภาอุตสาหกรรมแห่งประเทศไทย
- สายสุดา จันทรา. 2547. ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศกับดัชนีตลาดหลักทรัพย์บางประเทศในเอเชีย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สิรินธร คำตันสมบัติ. 2552. ทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับราคาหลักทรัพย์ของกลุ่มอสังหาริมทรัพย์และก่อสร้างในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อุษสยา แพทย์เจริญ. 2552. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับ ดัชนีหมวดธุรกิจในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- _____. 2550. “ชีวิตหลังต้มยำกุ้งฉบับแมงเม่า.” [ระบบออนไลน์]. แหล่งที่มา <http://www.oknation.net/blog/> (6 พฤษภาคม 2553)

_____. 2550. “วิกฤติซัพไพร์มความปั่นป่วนในตลาดเงินโลก.” [ระบบออนไลน์]. แหล่งที่มา
<http://www.positioningmag.com> (6 พฤษภาคม 2553)

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.

Ajayi, R. A. and Mougoue, M. 1996. “On the dynamic relation between stock prices and Exchange rate.” *The Journal of Financial Research* 19:193-207

Andros Gregoriou and Alexandros Kontonikas. 2009. “The long-run relationship between stock prices and goods prices: New evidence from panel cointegration.” **Journal of Finance Market and Money** 11-23 Available : <http://www.elsevier.com/locate/intfin> (30 January 2010)

Appleyard, D.R. and Field, A.J. 2001. *International Economic.* 4th ed. Singapore: MC Grawhill

Arellano, M., and S. Bond. 1991. “Some Tests of Specification for Panel Data: Monte Carlo Evidence and An Application to Employment Equations.” *Review of Economic Studies* 58: 277-297.

Baltagi, Badi Ho. 2001. **Econometric analysis of panel data.** 2nd ed. West Sussex: John Wiley & Son.

Badi H. Baltagi. 2005. **Econometric analysis of panel data.** 3rd ed. West Sussex: John Wiley & Son.

Dimitrova, Desislava. 2005. “The relationship between exchange rates and stock prices: Studied in a Multivariate model.” **Political Economy The College of Wooster** 14 (August)

Gujarati, Damodar N. 2003. **Basic econometrics.** 4th ed. Singapore: McGraw-Hill

Hadri, Kaddour. 2000. “Testing for stationary in heterogeneous panel data.” **Econometric Journal** 3: 148-161.

Im, K.S; Pesaran, M.H and Shin, Y. 2003. “Testing for unit roots in heterogeneous panels.” **Journal of Econometrics** 115: 53-74.

Indiana University. 2006. “Panel Data Model.” [Online]. Available
www.indiana.edu/~statmath/stat/all/panel/panel3.html (5 April 2010)

Kao, Chihwa. 1999. “Spurious regression and residual-based tests for cointegration in panel data.” **Journal of Econometrics** 90 (1): 1-44.

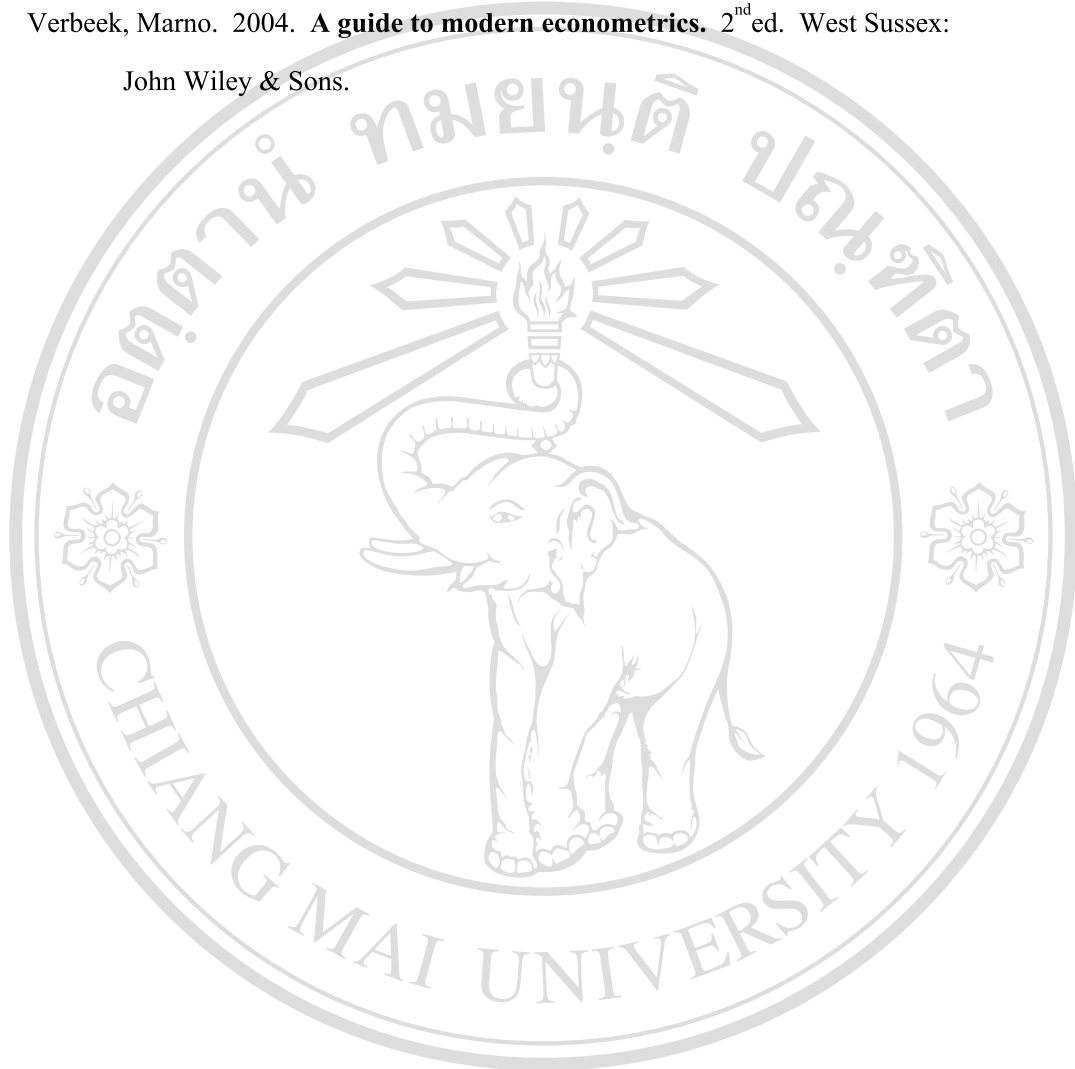
- Kao, C., M.H. Chiang, and B. Chen. 1999. "International R&D Spillover: An Application of Estimation and Inference in Panel Cointegration." *Oxford Bulletin of Economics and Statistics* 61: 691-709.
- Kate Phylaktis and Fabiola Ravazzolo. 2005. "stock prices and exchange rate dynamics." **Journal of International Money and Finance** 24:1031-1053 Available : <http://www.elsevier.com/locate/econbase> (30 April 2010)
- Levin, A; Lin, C.F and Chu, C. 2002. "Unit root tests in panel data : Asymptotic and finite-sample properties." **Journal of Econometrics** 108: 1-24.
- Maddala, G.S and Wu, S. 1999. "A comparative study of unit root tests with panel data and a new simple test." **Oxford Bulletin of Economics and Statistics** 61: 631-52.
- Mishkin, F. S. 2001. "The transmissions mechanism and the role of asset prices in monetary Policy." **NBER Working Paper** No.8617
- Nieh, Chien-Chung and Nieh, Cheng-Few. 2001. "Dynamic Relationship Between Stock Prices And Exchange Rate for G-7 Countries." **The Quarterly Review of Economics and Finance** 41:477-490. Available: <http://www.sciencedirect.com> (25 April 2010)
- Nishat, Mohammed and Mustafa, Khalid. 2000. "Exchange Rate and Stock Prices Relationship: An Empirical Evidence from Pakistani Financial Market." **Review of finance Economics** 11: 356-368 Available: <http://www.sciencedirect.com> (26 April 2010)
- Oscar Terres-Reyna. (No date). "Panel Data Analysis Fixed & Random Effects." [Online]. Available: dss.princeton.edu/training/Panel101.pdf
- Pedroni, P. 1999. "Critical values for cointegration tests in heterogeneous panels with multiple regressors." **Oxford Bulletin of Economics and Statistics**, Special Issue, p. 653-670.
- Pedroni, P., 2001. Purchasing power parity tests in cointegrated panels. *Review of Economics and Statistics*, 83(4): 727-731, November.
- Pedroni, P., 2004. Panel cointegration: asymptotic and finite sample properties of pooled time series tests with an application to the PPP hypothesis: new results. *Econometric Theory* 20, 597-627.
- Phillips, P. and Hansen, B. 1990 "Statistical inference in instrumental variables regression with I(1) processes." **Review of Economic Studies**. 57: 99-125.

Phillips, P.C.B., Moon, H., 1999. Linear regression limit theory for nonstationary panel data.

Econometrica 67, 1057–1111.

Verbeek, Marno. 2004. **A guide to modern econometrics**. 2nd ed. West Sussex:

John Wiley & Sons.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved