

## เอกสารอ้างอิง

- คมสัน สุริยะ. (2552). แบบจำลองโลจิสติก: ทฤษฎีและการประยุกต์ใช้ในการวิจัยทางเศรษฐศาสตร์. เชียงใหม่: ศูนย์การวิเคราะห์เชิงปริมาณ คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ณัฐชัย เศรษฐ์สรกุล. (2550). ตัวอย่างการวิเคราะห์การบริโภคมวลรวมของภาคเอกชนด้วยตัวแบบ VAR โดยใช้โปรแกรม Eviews. แหล่งที่มา;  
<http://www.freewebs.com/nattakae/consume1.pdf>
- คณัย ไชยสาร. (2551). การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมและดัชนีตลาดหลักทรัพย์ โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.(2553).ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ SET-50. แหล่งที่มา;  
<http://marketdata.set.or.th/mkt/sectorquotation.dosector=95&industry=0&country=TH>
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.(2553).ราคาดัชนีตลาดหลักทรัพย์. แหล่งที่มา;  
<http://marketdata.set.or.th/mkt/sectorialindices.do?language=th&country=TH>
- ธนาคารแห่งประเทศไทย .(2553).ตลาดการเงิน. แหล่งที่มา;  
<http://www.bot.or.th/THAI/FINANCIALMARKETS/Pages/index.aspx>
- ประเสริฐ ไชยทิพย์.(2547). ทฤษฎีวงจรธุรกิจและการคาดคะเนขั้นสูง. เชียงใหม่. คณะเศรษฐศาสตร์, มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ประเสริฐ ไชยทิพย์ และคณะ. (2552). **Thailand's International Tourism Demand: The ARDL Approach to Cointegration.** แหล่งที่มา; <http://www.upet.ro/annals/pdf/Annals-2009-Part3.pdf>
- ประหยัด จิโนเป็ง. (2551). การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดเอ็มเอไอ โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปวีรินทร์ อินทธีรา. (2552). การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างภาษีมูลค่าเพิ่มและดัชนีราคาผู้บริโภคของประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- รุจิรา กุศลเลิศจริยา.(2551). การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างดุลสินค้าและบริการกับอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศกำลังพัฒนา. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ลภาพรรณ ลาภมาก.(2548). การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยแบบจำลองฟาร์มาและเฟนซ์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วิโชติ ตั้งศักดิ์พร. (2540). การปรับตัวของอัตราดอกเบี้ยระยะสั้นในประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ศิริรัตน์ ญาติจอมอินทร์. (2546). การวิเคราะห์บทบาทของรายได้ประชาชาติและอัตราการแลกเปลี่ยนที่มีต่อดุลการค้าไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สำนักพัฒนาการท่องเที่ยว.(2553).สถิตินักท่องเที่ยว (Tourists Arrival in Thailand)(2007-2008. แหล่งที่มา ;[http://www.tourism.go.th/index.php?option=com\\_content&task=view&id=2610&Itemid=25](http://www.tourism.go.th/index.php?option=com_content&task=view&id=2610&Itemid=25)
- อังคณา ทาก้า. (2552). การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาทองคำและราคาน้ำมันในประเทศไทยโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เอกรัตน์ ต.เจริญ.(2549). การวิเคราะห์ปัจจัยเชิงเศรษฐศาสตร์ที่มีผลกระทบต่ออัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มสื่อและสิ่งพิมพ์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เอนก อุปรา. (2548). การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มบันเทิงและสันทนาการโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Bahmani-Oskooee and Mohsen. 1998. "Cointegration Approach to Estimate the Long-run Trade Elasticities in LDCs." *International Economic Journal* 12, 3:89-96
- Bahmani-Oskooee and Goswami, Gour. 2003. "A Disaggregated Approach to the Japanese Trade." *Journal of Applied Economics* (In press)
- Burger C.J.S.C., Dohnal, M., Kathrada, M., Law, R., (2001), **A practitioners guide to timeseries methods for tourism demand forecasting- a case study of Durban, South Africa,** *Tourism Management* 22, pp.403-409

- D.M.Gujarati (1995), *Basic Econometrics*, Ch.21, Fourth Edition (McGraw-Hill)
- Divisekera, S., (2003), **A Model of Demand for International Tourism**, *Annals of Tourism Research*, Vol. 30, No. 1, pp. 31–49
- Domencich, Thomas and Daniel McFadden. 1975. **Urban Travel Demand : A Behavioral Analysis** Amsterdam: North-Holland Publishing Company.  
<http://www.econ.berkeley.edu/~mcfadden /travel.html>
- Engle, R.F. and Granger, C.W.J. (1987), Cointegration and Error Correction: Representation, Estimation and Testing, *Econometrica*, Vol. 55, pp.251-276.
- Greene, W.H (2003), **Econometric Analysis**, Ch.20.3 – 20.5, Fifth Edition, Prentice Hall.
- Habibi, Fateh, Abdul Rahim, Khalid. And Chin, Lee. 2008. United Kingdom and United States Tourism Demand for Malaysia: A Cointegration Analysis: Working paper No. 13590. University Putra Malaysia.
- Hendry, D. (1986), **Econometric Modelling with Cointegrated Variables: An Overview**, *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, Vol.48, pp.210-210.
- Hoffman, D.L. and Rasche, R.H. 1997. STLS/US-VECM6.1:A Vector Error-Correction Forecasting Model of the U.S. Economy: Working Paper 97-008A. ST. Louis: Federal Reserve Bank of ST.Louis.
- Judge, George, et al. 1988. **Introduction to the Theory and Practice of Econometrics**. 2nd ed. New York: John Wiley and Sons
- P.Kennedy (1996), **A Guide to Econometrics**, Ch.17.4 -17.6, Fourth Edition (Blackwell).
- Pesaran, M.H., Shin, Y. and Smith, R. J. (2001). “Bounds Testing Approache to the Analysis of Level Relationships”. *Journal of Applied Econometrics*. 16, 289 - 326.
- Pesaran, M.H., and Pesaran, B. (2009). **Time Series Econometrics using Mircrofit 5.0**. Oxford University Press. Oxford.
- Prasert Chaitip, N. Rangaswamy and Chukiat Chaiboonsri. (2006). “Modeling International Tourism Demand in Thailand”. **Working Paper Series 3/2006**. LSD Center Chiang-Mai, Thailand.
- Walter Enders. (1995). **Applied Econometric Time Series: Instructor's Resource Guide**