

## เอกสารอ้างอิง

- ฉัตรทิพย์ นาถสุภา. 2514. เศรษฐศาสตร์การเงินระหว่างประเทศ. กรุงเทพฯ: ไทยวัฒนา พานิช.
- ชาลินี แสตนนรินทร์. 2550. ผลกระทบของอัตราแลกเปลี่ยนที่มีต่อมูลค่าสินค้าส่งออกที่แท้จริงของประเทศไทยไปยังสหรัฐอเมริกา. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ชุตยารัตน์ เต็ดขาด. 2546. การวิเคราะห์ผลกระทบของการเคลื่อนไหวของอัตราแลกเปลี่ยนที่มีต่อระดับราคาและผลผลิตของประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ฐาปนา ฉิ้นไพศาล. 2542. การเงินระหว่างประเทศ. กรุงเทพฯ: ชีระฟิล์ม และ ไซเท็กซ์.
- ฉพล หงสกุลวสุ. 2550. ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนและ การเคลื่อนย้ายทุน ของประเทศในเอเชีย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- นิฐิตา เบญจมสุทิน และ นงนุช พันธกิจไพบูลย์. 2547. เศรษฐศาสตร์ระหว่างประเทศ **International Economics**. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์แห่งจุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- พรายพล คุ่มทรัพย์. 2547. เศรษฐศาสตร์การเงินระหว่างประเทศ: ทฤษฎีและนโยบาย. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- พิสิฐ ลี้อาธรรม. 2551. เศรษฐกิจไทยกับความเสี่ยงในทิศทางการพัฒนาเศรษฐกิจมหภาค การเงิน การคลัง เล่ม 3. กรุงเทพฯ: คณะทำงานเศรษฐกิจมหภาค การเงินการคลัง สภาที่ปรึกษาเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ
- ภัทรานิษฐ์ ศรีชัยรัตน์. ผลกระทบของความผันผวนอัตราแลกเปลี่ยนที่มีต่อมูลค่าสินค้าส่งออกที่แท้จริงของประเทศไทยไปยังประเทศญี่ปุ่น. รายงานกระบวนวิชา 751409. คณะ เศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

- Akhtar, M., Spence Hilton, R., 1984. "Effects of exchange rate uncertainty on German and US trade Fed Reserve". **Bank New York Quart. Rev:** 7–16.
- Arize, A., Osang, T. and Slottje, D. 2000. "Exchangerate volatility on foreign trade: evidence from thirteen Large Developed countrys" **Journal of Business Economics Statistics** 18: 10-17.
- Bollerslev, Engle and Wooldridge. 1988. "Generalized autoregressive conditional heteroskedasticity" **Journal of Econometrics** 31: 307-327.
- Campa, Jose and Linda Goldberg. 2002. Exchange Rate Pass-Through Into Import Prices: A Macro or Micro Phenomenon?". **NBER Working Paper Series.** (May): 1-24.
- Chowdhury, Taufiq. 2005. "Exchange Rate volatility and the United States export: evidence from Canada and Japan." **Journal of The Japanese and Internation Economies** 19: 51-71.
- Dickey, D.A., and W.A, Fuller. 1981. "Likelihood ratio statistic for autoregressive time series with a unit root" **Econometrica** 49. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์.** เชียงใหม่:คณะเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Ender, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series.** New York: John & Sons
- Engle and Kroner. 1955. "Autoregressive conditional heteroscedasticity with estimates of the variance of United Kingdom inflation" **Econometrica** 50: 987-1007.
- Engle, R. F. and Granger, C.W.J. 1987. "Cointegration and Error Correction: Representation, Estimate and testing." **Econometrica** 55, 2: 251-276.
- Engle, R.F. 2002. "Dynamic conditional correlation: a new simple class of multivariate GARCH models" **Journal of Business and Economic Statistics** 20: 339-350.
- Froot, Kenneth and Paul Klemperer. 1989. Exchange Rate Pass-Through When Market Share Matters. **American Economic Review.** Vol.79 (September): 637-654.
- Giovannini, Alberto. 1988. Exchange Rate and Traded Good Prices. **Journal of International Economics.** Vol.24 (February): 45-68.

- Goldberg, Pinelopi and Michael Knetter. 1997. Goods Prices and Exchange Rates: What Have We Learned?. NBER **Working Paper Serie**. (December): 1-38.
- Herzberg, Valerie, George Kapetanios and Simon Price. 2003. Import Prices and Exchange Rate Pass-Through: Theory and Evidence from the United Kingdom. **Bank of England**. Working Paper 182: 1-26.
- Knetter, Michael. 1989. Price Discrimination by U.S. and German Exporters. **American Economic Review**. Vol.79 (March): 198-210.
- MacDonald, Ronald. 1995. "Long-Run exchange rate modeling : A survey of the recent evidence." **IMF Staff Papers** 42, 3 (September): 437-483.
- MacDonald, R. and Taylor, M.P. 1995. "The monetary model of the exchange rate : Long-Run relationship, Short-Run dynamic and how to beat a random walk." **Journal of International Money and Finance** 13: 276-290.
- MacKinnon, J.G. 1991. "Critical Value for Cointegration Tests" in **Long – run Relationship: Reading in Cointegration**. Edited by R.F. Engle and C. W. Granger, Oxford: Oxford University Press. pp. 267-276.
- Mckenzie, Michael D. 1998. "The impact of exchange rate volatility on Australian trade flows." **Journal of International Financial Markets Institutions and Money** : 21-38.
- Sercu, P., Uppal, R., 2003. "Exchange rate volatility and international trade: a general equilibrium analysis". **Europ.Econ. Rev.** 47, 429–442.
- Sugar, Abdul-Hamid and Hassen, Seid. 2001. "US export and time-varying volatility of Real exchange rate." **Global Finance Journal** 12:109-119.
- Summer, Daniel. 1985. Measurement of Monopoly Behavior: An Application to the Cigarette Industry. **Journal of Political Economy**. Vol89 (October): 1010-1019.