

เอกสารอ้างอิง

- ขวัญชนก สายศรีธิ. 2549. การวิเคราะห์แบบจำลองทางการเงินของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. “พฤติกรรมการส่งผ่านราคาทุ้งทุลาค้าระหว่างตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 33, 3 (กันยายน-ธันวาคม): 16-51.
- นฤมล เขาวนวิฑยางกูร. 2535. ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนในตลาดแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศกับตลาดหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- พลายพล คุ่มทรัพย์. 2547. เศรษฐศาสตร์การเงินระหว่างประเทศ. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
- โยะชิฮะระ คุนิโอะ. 2546. ชาติและการเติบโตทางเศรษฐกิจ:เกาหลีและไทย. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
- รังสรรค์ หทัยเสรี. 2538. “Cointegration and Error Correction Approach : ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ 13, 3 (กันยายน): 20-55.
- รัตนา เถลิว. 2549. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลต่อการกำหนดอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- วเรศ อุปปาดิก. 2544. เศรษฐศาสตร์การเงินและการธนาคาร. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
- ศิริลักษณ์ เต็กสมบูรณ์. 2531. การวิเคราะห์อนุกรมเวลา: ตำราประกอบการเรียนวิชาอนุกรมเวลาและเลขดัชนี. มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ.
- อนัสปรีย์ ไชยวรรณ. 2546. การประยุกต์ใช้ โคอินทีเกรชั่น และแบบจำลองเอเรอร์คอร์เรคชัน กับอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศในภูมิภาคเอเชีย. วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตร์มหัพพันิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อลิส سرا บุญไชย. 2549. ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงและส่วนต่างของอัตราดอกเบี้ยที่แท้จริง. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหัพพันิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Bollerslev, Tim. 1986. "Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity." **Journal of Econometrics** 31 : 307-327.
- Campbell, John Y; Lo, Andrew W and MacKinley, A.Craig. 1997. **The Econometrics of Financial Markets**. New Jersey: Princeton University Press.
- Corsetti, Giancarlo; Pesenti, Paolo and Roubini, Nouriel. 2001. **The Role of Large Players in Currency Crises**. available <http://www.nber.org/papers/w8303>. (May 2001).
- Enders, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series**. New York : John Wiley & Sons.
- Glick , Reuven and Rose, Andrew K. 2000. "Contagion and trade : Why are currency crises regional?." In **The Asian Financial Crisis : Causes, Contagion and Consequences**. pp.284-310. Edited by Pierre-Richard Agenor; Marcus Miller; David Vines and Axel Weber. Cambridge: Cambridge University Press.

Gujarati, Damodar N. 1995. **Basic Econometrics**. Economic Series. 3rd ed. New York: McGraw – Hill.

Krugman, P. 1997. **Currency Crises**. Available: <http://web.mit.edu/krugman/www/> .

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.

Masson, Paul. 2000. “Contagion : monsoonal effects, spillovers and jumps between multiple equilibria.” In **The Asian Financial Crisis : Causes, Contagion and Consequences**. pp.265-278. Edited by Pierre-Richard Agenor; Marcus Miller; David Vines and Axel Weber. Cambridge: Cambridge University Press.

Shiller,R. 1989. **Market Volatility**. Cambridge: MIT Press.

Tsay, Ruey S. 2005. **Analysis of Financial Time Series**. New Jersey: John Wiley & Sons.

Warajhit Songcharoen. 1999. **The Relationship between exchange rate volatility and capital flows in Thailand from 1984 to 1997**. PhD. Dissertation, The College of Business Administration United States International University.

Zivot, Eric and Wong, Jiahui. 2006. **Modeling Financial Time Series with S-PLUS**. New York: Springer.