บรรณานุกรม

กรมเจรจาการค้าระหว่างประเทศ. 2552. **ศูนย์ข้อมูลการเจรจา.** แหล่งที่มา: http://61.19.225.10/dtn/tradeinfo/dtn_page.php?tap=doc_comment&ref_id=179 (25 ตุลาคม 2552).

ดวงเนตร บุญบำรุง. 2550. **การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนของค่าเงินบาทกับค่าเงินดอลลาร์สหรัฐอเมริกาตามทฤษฎีอัตราดอกเบี้ยเสมอภาคโดยวิธีโคอินทิเกรชัน .** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ .

ดวงใจ อภิรัตน์สกุล. 2541. **การทดสอบการเคลื่อนไหวของอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศไทยตามแนวคิดค่าเสมอภาคของอำนาจซื้อ .** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยหอการค้าไทย .

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2548. **เศรษฐมิติ: เอกสารประกอบการสอน.** เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ .

ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2550. **สถิติตลาดการเงิน.** แหล่งที่มา: http://www.bot.or.th/Thai/Statistics/FinancialMarkets/ExchangeRate/_layouts/application/exchangerate/ExchangeRate.aspx (1 กันายายน 2552).

ผจงจิต ติ๊บประสอน. 2551. **ผลกระทบของการบริโภคพลังงานต่อการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของประเทศไทย.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

พรายพล คุ้มทรัพย์. 2551. **เศรษฐศาสตร์การเงินระหว่างประเทศ : ทฤษฎีและนโยบาย** . พิมพ์ครั้งที่ 2. กรุงเทพฯ : สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

รังสรรค์ หทัยเสรี. 2538. “Cointegration and Error Correction Approach: ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของประเทศไทย .” **วารสารเศรษฐศาสตร์ธรรมศาสตร์** 13, 3(กันยายน): 20-55.

วรุจิรา กุศเลิศจริยา. 2551. **การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างดุลสินค้าและบริการกับอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศกำลังพัฒนา .** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ .

วีรพงษ์ รามางกูร. 2548. **จีนเปลี่ยนระบบอัตราแลกเปลี่ยน**. แหล่งที่มา: http://www.nidambe11.net/ ekonomiz/2005q3/article2005aug08p1.htm (30 ตุลาคม 2552).

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

ศิรินภา ศรีมณี. 2551. **ผลกระทบของวิกฤตการณ์ราคาน้ำมันต่อระบบเศรษฐกิจมหภาค .** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

อรุณศรี แซ่ฉั่ง. 2549. **การพรรณนาพฤติกรรมการเคลื่อนไหวอัตราผลตอบแทนส่วนเกินของพันธบัตรรัฐบาลประเทศไทยโดยใช้แบบจำลอง STAR.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร - มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ .

Abuaf, N. and Jorion, P. 1990. "Purchasing power parity in long run." **Journal of Finance** 45: 157-174.

Adler, M. and Lehmann, B. 1983. "Deviations from purchasing power parity in the long run." **Journal of Finance** 38: 1471-1487.

Balke, N.S. and Fomby, T.B. 1991. "Shifting trends, segmented trends, and infrequent permanent shocks." **Journal of Monetary Economics** 28: 61-85.

Benninga, S. and Protopapadakis, A. 1988. "The equilibrium pricing of exchange rates and assets when trade takes time." **Journal of International Money and Finance** 7: 129-149.

Brock, W. A. Dechert, W. D. LeBaron, B. and Scheinkman, J. A. 1996. "A Test for Independence Based on the Correlation Dimension." **Economic Review** 15: 197-235.

Cassel, G. 1918. Abnormal Deviations in International Exchanges. **Economic Journal** 28: 413-415.

Cheung, Y-W. and Lai, K. 1993. "A fractional cointegration analysis of purchasing power parity." **Journal of Business & Economic Statistics** 11: 103-112.

China Radio International. 2008. **China Economy.** Source: http://thai.cri.cn/jingji09.htm (14 December 2009)

Cochrane, J.H. 1988. "How Big Is the Random Walk in GNP?" **Journal of Political Economy** 96: 89 -920.

Corbae, D. and Ouliaris, S. 1988. "Cointegration and tests of purchasing power parity." **Review of Economics and Statistics** 70: 508-511.

Davutyan, N. and. Pippenger, J. 1990. "Testing PPP: Some Evidence on the Effects of Transactions Costs". **Econometric Reviews**. 211-240.

Dickey, D.A. and Fuller, W.A. 1981. "Likelihood Ratio Statistics for Autoregressive Time Series with a Unit Root." **Econometrica** 49: 1057-1072.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

Diebold, F. X. Husted, S. and Rush, M. 1991. "Real Exchange Rates under the Gold Standard." **Journal of Political Economy**. University of Chicago Press 99: 1252-1271.

Dijk, V. and Franses, P.H. 2002. **Non-linear Error Correction Models for Interest Rate in The Netherland in Non-linear Econometric Modeling in The Times Series Analysis.** Cambridge: Cambridge University Press.

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

Dornbusch, R. 1976. "Expectations and Exchange Rate Dynamics." **Journal of Political Economy** 84: 1161-1176.

Dumas, B. 1992. "Dynamic Equilibrium and the Real Exchange in Spatially Separated World." **Review of Financial Studies** 5: 153-180.

Edison, H.J. 1987. "Purchasing Power Parity in the Long Run." **Journal of Money, Credit and Banking** 19: 376-387.

Enders, W. 1995. **Applied econometric time series.** New York: John Wiley & Sens.

Enders, W. 1988. ARIMA and cointegration tests of PPP under fixed and flexible exchange rates regimes. **Review of Economics and Statistics**. 504-508.

Engle, R.F. and C.W.J. Granger. 1987. "Co - integration and Error Correction: Representation, Estimation, and Testing." **Econometric 55**: 251-276.

Frenkel, J.A. 1978. "Purchasing Power Parity: Doctrinal Perspective and Evidence from the 1920s." **Journal of International Economics** 8: 169-191.

Frankel, J.A. 1986. "International Capital Mobility and Crowding out in the US Economy: Imperfect Integration of Financial Markets or Goods Markets?" In Hafer, R.W. (ed.), **How Open is the US Economy?**, Lexington: LeXington Books.

Granger, C. W. J. and Teräsvirta, T. 1993. **Modelling Nonlinear Economics Relationships.** Oxford University Press. Oxford.

Grilli and Kaminsky. 1991. V.Nominal exchange rate regimes and the real exchange rate. **Journal of Monetary Economics** 27: 191-212.

Gujarati, Damodar N. 1995. **Basic econometrics.** 3rd ed. New York: McGraw-Hill.

Haggan , V. and Ozaki, T. 1981. "Modelling Nonlinear Random Vibrations Using an Amplitude-Dependent Autoregressive Time Series Model." **Biometrika** 68: 189 - 196.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

Hakkio, Craig S. 1984. A re-examination of purchasing power parity : A multi-country and multi-period study. **Journal of International Economics**. 265-277.

In, F. and Sugema, I. 1995. Testing Purchasing Power Parity in a Multivariate Co-Integrating Framework. **Applied Economics**. 891-899.

Johansen, s. 1991. "Estimation and Hypothesis Testing of Cointegrating Vectors in Gaussian Vector Autoregressive Models." **Econometrical** 59: 1551-1580.

Johansen, s. 1988. "Statistical Analysis of Cointegrating Vectors." **Journal of Economic Dynamics and Control** 12: 231-254.

Kim, Y. 1990. "Purcasing Power Parity in the Long Run : A Cointegration Approach." **Journal of Money, Credit, and Banking** 22: 491-503.

Krugmah, P.R. 1978. "Purchasing Power Parity and Exchange Rate: Another Look at the Evidence." **Journal of International Economics** 8: 397-407.

Lotaian, J.R. and M.P.Taylor, M.P. 1996. "Real Exchange Rate behavior: Tha Recent Float from the Perspective of the Past Two Centuries." **Journal of Political Economy** 104: 488-510.

MacKinnon, J.G. 1991. "Critical Values for Cointegration Tests" in Long - Run Economic Relationships." Readings in Cointegration, eds. R.F.Engle and C. W.J.granger, New York. **Oxford University Press.** 266-276.

MacKinnon, J.G. 1996. "Numerical distribution functions for unit root and cointegration tests." **Journal of Applied Econometrics** 11: 601-618.

Michael, P.; Nobay, R. A., and Peel, D. A. 1997. Transactions costs and nonlinear adjustment in real exchange rates: an empirical investigation. **Journal of Political Economy** 105: 862-879.

Michael, Panos; Nobay, A Robert; and Peel, David A. 1994a. "Exchange Rates, Transactions Bands and Cassel's Doctrine of PPP." **Research Paper no.9403**. Liverpool: Univ. Liverpool, Dept. Econ., November 1994.

Michael, Panos; Nobay, A Robert; and Peel, David A. 1994b. "Purchasing Power Parity Yet Again: Evidence Spatially Separate Commodity Markets." **J.Internal, Money and Financial** 13 (December 1994): 637-657.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

Martín J. A. J. and Fernández M. D. R. 2005. "Non-linear adjustment to purchasing power parity: an analysis using Fourier approximations." **Working Paper or Technical Report**. Complutense University of Madrid.

Said, S. and Dickey, D.A. 1984. "Testing for Unit Roots in Autoregressive - Moving Average Models of Unknowm Order." **Biometrika** 71: 599-607.

Sarno, L. and M.P. Taylor. 1998. "Real Exchange Rates Under the Recent Float: Unequivocal Evidence of Mean Reversion." **Economics Letters** 60: 131-137.

Sarno, L. and Taylor, M.P. 2001a. "The Microstructure of the Foreign Exchange Market: A Selective Survey of the Literature." **Princeton Studies in International Economics** 89. International Economics Selection, Princeton University.

Sarno, L. and Taylor, M.P. 2001b. "Official Intervention in the Foreign Exchange Market: Is it Effective and, if so, How Does it Work?". **Journal of Economic Literature**, Forthcoming.

Sarno, L. and Taylor, M.P. 2002. **The Economics of Exchange Rates**. Cambridge University Press.

Sercu, P.; Uppal, R. and Hulle, C.V. 1995. The exchange rate in the presence of transaction costs: Implications for tests of relative purchasing power parity. **Journal of Finance** 50: 1309-1319.

Templeboxing. 2008. **Investment and Financial Planning Community in Thailand.** Source: http://www.templeboxing.com/index.php?board=7.0 (15 December 2009)

Teräsvirta, T.; TjØstheim, D. and Granger, C. W. J. 1994. **Aspects of modeling nonlinear time series.** in R. F. Engle and D. L. McFadden (eds.) Handbook of econometrics 15. Amsterdam: Elsevier Science.

Thacker, J. I. 1995. The role of density dependence and weather in determining aphid abundance. **PhD thesis**. Univ. of East Anglia, Norwich, UK.

Tong, H. 1990. **Non-Linear Time Series: A Dynamical System approach**. Oxford University Pree. Oxford.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved