

เอกสารอ้างอิง

- ตีรณ พงศ์มพัฒน์ . 2541. เศรษฐศาสตร์มหภาค ทฤษฎี นโยบาย – การวิเคราะห์สมัยใหม่ .
กรุงเทพฯ.จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2548. เศรษฐมิติ : เอกสารประกอบการสอน. เชียงใหม่ : คณะเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- รัตนา สายคณิต ม 2539. มหเศรษฐศาสตร์วิเคราะห์ จากทฤษฎีสู่ นโยบาย . กรุงเทพฯ . จุฬาลงกรณ์
มหาวิทยาลัย
- สุนิสา คำแก้ว. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างเงินเฟ้อของประเทศไทยกับอัตราการเจริญเติบโต
ทางเศรษฐกิจ.วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ , 2549.
- Anthony Garratt, Kevin Lee, M.Hashem Pesaran และ Yongcheol Shin."A Long Structural
Macroeconomic Model of the UK".**The Journal of UK**: University of Cambridge, 2001.
- Herman J.Bierens." VAR models with exogenous variables". **Lecture Notes**: The Pennsylvania
State University. February 21, 2004.
- Johansen, S."Statistical Analysis of Cointegration Vectors". **Journal of Economic Dynamics
and Control**. 1988, Vol.12 , 231 – 254.
- Johansen, S. and Juselius, K."Maximum Likelihood estimation and Inference on Cointegration –
With Applications to the Demand for Money". **OXFORD BULLETIN OF
ECONOMICS AND STATISTICS**. 1990, Vol. 52.2, 169 – 210.
- Jordi Gali and Tommaso Monacelli . "Monetary Policy and Exchange Rate Volatility in a Small
Open Economy " . **Review of Economic studies**. 2005, 72 , 707 – 734 .
- Liew, Venus Khim – Sen. "Which Lag Length Selection Criteria Should We Employ?"
Economics Bulletin. 2004 Vol. 3, No. 33 pp. 1–9

Lothian, J.R., Taylor, M.P. "Real exchange rate behavior: the recent float from the perspective of the past two centuries". **Journal of Political Economy**. 1996, 104, 488–509.

M.Hashem Pesaran , Till Schuermann and Scott M.Weiner : PSW. "Modeling Regional Interdependencies Using a Global Error – Correcting Macroeconometric Model". **Journal of Business & Economic Statistic**. 2003.

Pesaran, M. Hashem and Smith, Ron P." Macroeconometric Modelling with a Global Perspective". **Institute of Economic Policy Research Working Paper**. 2006, Working Paper Series No. 1659

N.Gregory Mankiw. **Macroeconomics**. Second printing . New York : Worth Publishers .2007.

Oliver Blanch.**Macroeconomics**.New Jersey : Pearson Prentice Hall.2006.

R.F. Engle, C.W.J. Granger."Cointegration and error correction: representation, estimation and Testing". **Econometrica**. 1987, vol.55, 251 – 276.

SAS Institute Inc. 2009. Support & training. แหล่งที่มา : http://support.sas.com/documentation/cdl/en/etsug/60372/HTML/default/etsug_varmax_sect030.html

Stephane Dees , Filippo di Mauro , M.Hashem Pesaran and Vanessa Smith : DdPS."Exploring the International Linkages of the Euro Area : a Global VAR Analysis". **Journal of Applied econometrics**. 2004.

Walter Ender. 1995.**Appiled Econometric Time Series**. New York : John Wiley & Sens.