

เอกสารอ้างอิง

โชติชัย สุวรรณภรณ์. 2551. **วิกฤตการณ์ Subprime ของสหรัฐ และผลกระทบต่อประเทศไทย.**

[ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา: [http://www.nidambe11.net/ekonomiz/2008q1/](http://www.nidambe11.net/ekonomiz/2008q1/2008February22p2.htm)

2008February22p2.htm.

ฐิติศักดิ์ กิตติศักดิ์ธาดากุล. 2552. **ผลกระทบต่อความผันผวนของเงินเฟ้อและอัตราแลกเปลี่ยนต่อความผันผวนของจำนวนนักท่องเที่ยวต่างชาติที่เข้ามาเที่ยวในประเทศไทย โดยวิธี มัลติทวาริเอทการซ์.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ณพล หงสกุลวสุ. 2550. **ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนและการเคลื่อนย้ายทุน ของประเทศในเอเชีย.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

นฤมล เขาวนวิฑูร. 2542. **ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนในตลาดแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ กับตลาดหลักทรัพย์.** เชียงใหม่: วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐกิจ: ทฤษฎีและการประยุกต์.** เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐกิจ: ทฤษฎีและการประยุกต์.** เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ อ้างถึงใน สรณพล วิเชียรรัตนพันธ์. 2547. **การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการซ์เอ็ม: กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มอสังหาริมทรัพย์.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ภูวดล ทิมะณี. 2552. **การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราดอกเบี้ยกับการลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศ โดยวิธีไบวาริเอทการซ์.** การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ไพศาล พรเศรษฐเมธากุล. 2534. **อิทธิพลของการเปลี่ยนแปลงอัตราดอกเบี้ยต่างประเทศที่มีต่ออัตราดอกเบี้ยไทย.** ภาคนิพนธ์พัฒนบริหารศาสตรมหาบัณฑิต สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์.

- สายสุดา จันทรา. 2547. ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศกับดัชนีตลาดหลักทรัพย์บางประเทศในเอเชีย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อุมากร เตรียมพัฒนา. 2545. การวิเคราะห์ความเสี่ยงในหุ้นกลุ่มอสังหาริมทรัพย์และตกแต่งในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีโคอินทิเกรชัน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต 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 BusinessEconomics Statistics** 18: 10-17.
- Bollerslev, Engle and Wooldridge. 1988. "Generalized autoregressive conditional heteroskedasticity" **Journal of Econometrics** 31: 307-327.
- Choudhry, Taufiq. 2005. "Exchange Rate volatility and the United States export: Evidencefrom Canada and Japan." **Journal of The Japanese and Internation Economics**19: 51-71.
- CIA World Factbook. 2010. **Economy overview**. [Online]Available:<https://www.cia.gov/library/publications/the-world-factbook/geos/us>.
- 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: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- 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.
- Global Trade Information Services. 2010. **Thailand Export Statistics UDG: Agri. Product, Total Agricultural Product**. [Online] Available:<http://www.gtis.com/gta/>.
- 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.
- International Monetary Fund. 2010. **World Economic Outlook Databases**. [Online] Available: <http://www.imf.org/external/pubs/ft/weo/2009/02/weodata>.
- Knetter, Michael. 1989. Price Discrimination by U.S. and German Exporters. **American Economic Review**. Vol.79 (March): 198-210.
- Ling, S. and McAleer, M. 2003. "Asymptotic theory for a vector ARMA-GARCH model" **Econometric Theory** 19: 278-308.
- MacDonald, Ronald. 1995. "Long-Run exchange rate modeling : A survey of the recent evidence." **IMF Staff Papers** 42, 3 (September): 437-483.
- 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.
- Summer, Daniel. 1985. Measurement of Monopoly Behavior: An Application to the Cigarette Industry. **Journal of Political Economy**. Vol89 (October): 1010-1019.