

บรรณานุกรม

ภาษาไทย

- ขนิษฐา มีสุข และประพันธ์ สายสงเคราะห์. 2523. การประมาณข้อมูลผลิตภัณฑ์ประชาชาติของ
ไทยเป็นรายเดือนและรายไตรมาส. กรุงเทพฯ: ธนาคารแห่งประเทศไทย.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2543. “ความสัมพันธ์ระหว่างราคาหุ้นกับคุณภาพของหุ้น
ในตลาดญี่ปุ่นและสหรัฐอเมริกา.” วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 4,
1(มกราคม-เมษายน): 94-115.
- ชัยวัฒน์ นิมมอนุสรณ์กุล. 2544. แบบจำลองเศรษฐกิจสำหรับภาครัฐบาลของประเทศไทย.
วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2535. 50 ปี ธนาคารแห่งประเทศไทย: 2485-2535. กรุงเทพฯ: ธนาคาร
แห่งประเทศไทย.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. คลังข้อมูล. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: <http://www.bot.or.th/bothmepage/index/index.asp>. 20 มกราคม 2546.
- สถาบันวิจัยเพื่อการพัฒนาประเทศไทย. ฝ่ายนโยบายเศรษฐกิจส่วนรวม. 2540. **Financial
Volatility และ Currency Speculation**. กรุงเทพฯ: สถาบันวิจัยเพื่อการพัฒนาประเทศ
ไทย.
- สำนักงานคณะกรรมการพัฒนาการเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ. **สรุปผลการพัฒนาเศรษฐกิจและ
สังคมตามแผนพัฒนาฯ ฉบับที่ 8 พ.ศ. 2543**. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา: http://www.nesdb.go.th/New_menu/develop_plan8. 3 สิงหาคม 2546.
- สุพรรณิ พัดมาสกุล. 2538. ผลของค่าความเข้มข้นของการเคลื่อนย้ายเงินทุนระหว่างประเทศต่อ
นโยบายการเงินในประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

ภาษาอังกฤษ

- Brooks, Chris and Rew, G. Alistair. 2002. “Testing for Non-stationarity and Cointegration
Allowing for the Possibility of a Structural Break: An Application to EuroSterling
Interest Rates.” **Economic Modelling** 19: 65-90.

- Budsaratagoon, Pomanong. 2002. "Money Market Integration." **Chulalongkorn Business Review** 24, 92: 35-60.
- _____. 1997. **International Market Integration A Study of Thai Market**. Ph.D. dissertation. Business Administration. Chulalongkorn University.
- Dickey, David A. and Fuller, Wayne A. 1981. "Likelihood Ratio Statistics for Autoregressive Time Series with a Unit Root." **Econometrica** 49 (July): 1057-1072.
- Edwards, Sebastian and Khan, Mohin S. 1985. "Interest Rate in Developing Countries." **Finance & Development** (June): 28-31.
- Enders, W. 1995. **Applied Econometric Time Series**. New York: John Wiley & Sons.
- Engle, Robert F. and Granger, C.W.J. 1987. "Co-integration and Error Correction: Representation, Estimation, and Testing." **Econometrica** 55 (March): 251-276.
- Geert, Bekaert and Campbell, R. Harvey. 1995. "Time-varying World Market Integration." **The Journal of Finance** 1, 2 (June): 403-444.
- Gregory, W. Allan and Hansen, Bruce E. 1996. "Residual-based Tests for Cointegration in Models with Regime Shifts." **Journal of Econometrics** 70: 99-126.
- Gujarati, D. 1995. **Basic Econometrics**. 3rd ed. New York: McGraw-Hill.
- Haque, Nadeem U. and Montiel, Peter. 1991. "Capital Mobility in Developing Countries: Some Empirical Tests." **World Development** 19, 10: 1391-1398.
- Hataiseree, Bungsun and Phipps, Anthony. 1996. "The Degree of Capital Mobility in Thailand : Some Estimates Using a Cointegration Approach." **Applied Economics Letters** 3 : 9-13.
- Johansen, S. 1991. "Estimation and Hypothesis testing of Cointegration Vectors in Gaussian Vector Autoregressive Models." **Econometrica** 59 (November): 1551-1580.
- Johansen, S. and Juselius, K. 1990. "Maximum Likelihood Estimation and Inference on Cointegration-with Applications to the Demand for Money." **Oxford Bulletin of Economics and Statistics** 52.
- Laffer, Arther B. and Miles, Marca. 1982. **International Economics in an Integrated World**. Glenview, IL: Scott, Foresman and Company.
- Lixing, Sun. 2000. "Time-Varying Estimates on the Openness of Capital Accounts in East Asia and Mexico." **The Developing Economies** 38, 2 (June): 164-85.

Pakorn Vichyanond. 1994. **Thailand's Financial System: Structure and Liberlization.**

Bangkok: Thailand Development Research Institute.

Perron, Pierre. 1989. "The Great Crash, the Oil Price Shock and the Unit Root Hypothesis."

Econometrica 57: 1361-1401.

_____. 1997. "Further Evidence on Breaking Trend Functions in Macroeconomic Variables."

Journal of Econometrics 80: 355-385.

Reisen, Helmut and Yeches, Helene. 1993. "Time-varying Estimates on the Openness of the Capital Account in Korea and Taiwan." **Journal of Development Economics** 41: 285-305.

Reuters. 2002. **Reuters Kobra 3.5.1.** [Online]. Available: Finance and Investment Center, Chiang Mai University. 14 January 2003.

Robinson et al. 1991. "Thailand : Adjusting to Success Current Policy Issues." **Occasional Paper** 85. Washington, D.C.: International Monetary Fund.