

## เอกสารอ้างอิง

- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์**. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- พรายพล คู่มิตรพิชัย. 2547. **เศรษฐศาสตร์การเงินระหว่างประเทศ: ทฤษฎีและนโยบาย**. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ภาคิน จิตโกเกษม. 2550. **ผลกระทบของความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนต่อระดับราคาสินค้าในประเทศไทย**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- รัตนา สายคณิต. 2539. **เศรษฐศาสตร์มหภาค**. พิมพ์ครั้งที่ 1. กรุงเทพฯ: ไทยวัฒนาพานิช.
- สรศักดิ์ บุญมี. 2540. **การสนองตอบของสินค้าเข้าและสินค้าออกของไทยต่อการเปลี่ยนแปลงราคาและอัตราแลกเปลี่ยน**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยรามคำแหง.
- อนัญญา กันตสุสิระ. 2531. **อิทธิพลของอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงต่อการส่งออกและการนำเข้า**. ภาคนิพนธ์คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันพัฒนาบริหารศาสตร์.
- อภิสิทธิ์ สรรพดิกล. 2547. **การส่งผ่านความไม่แน่นอนของปัจจัยที่มีผลในตลาดซื้อขายไฟฟ้าจากประสบการณ์ของต่างประเทศโดยใช้วิธีแบบจำลอง MULTIVARIATE GARCH**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- Bollerslev, Engle and Wooldridge. 1988. "Generalized autoregressive conditional heteroskedasticity" **Journal of Econometrics** 31: 307-327.
- Bollerslev, T. 1990. "Modelling the coherence in short run nominal exchange rates: a multivariate generalized ARCH approach" **Review of Economics and Statistics** 72: 498-505.
- Engle and Kroner. 1955. "Autoregressive conditional heteroscedasticity with estimates of the variance of United Kingdom inflation" **Econometrica** 50: 987-1007.
- Engle, R.F. 2002. "Dynamic conditional correlation: a new simple class of multivariate GARCH models" **Journal of Business and Economic Statistics** 20: 339-350.
- Glosten, L.J., Jagannathan, R. and Runkle, D. (1992), On the Relation Between the Expected value and Volatility of Nominal excess Return on Stocks, *Journal of Finance*, 46, 1779-1801.
- Keith Pilbeam, **International Finance (London : Collier Macmillan 2006)**, pp. 125 – 188.

Mckenzie, Michael D. 1998. "The impact of exchange rate volatility on Australian trade flows." **Journal of International Financial Markets Institutions and Money** 8: 21-38.

Ling, S. and M. McAleer, "Stationarity and the existence of moments of a family of GARCH processes", *Journal of Econometrics*, 106, 109-117, 2002.

McAleer, M., Hoti, S., and Chab, F. (2009), "Structure and Asymptotic Theory for Multivariate Asymmetric Conditional Volatility", *Econometric Reviews*, 28, 422-440.

Mckenzie, Michael D. and Krooks, Robert D. 1997. "The impact of exchange rate volatility on German – US trade flows." **Journal of International Financial Markets Institutions and Money** 7: 73-8

Tse, Y.K. and A.K.C. Tsui, "A multivariate generalized autoregressive conditional heteroscedasticity model with time-varying correlations", *Journal of Business and Economic Statistics*, 20, 351-362, 2002.