

## เอกสารอ้างอิง

- ชูเกียรติ ชัยบุญศรี. 2542. ผลกระทบของอัตราแลกเปลี่ยนที่มีต่อการส่งออกสินค้าเกษตรของประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ฐาปนา ฉิ่งไพศาล. 2542. การเงินระหว่างประเทศ. กรุงเทพฯ: ซีระฟิล์ม และไซเท็กซ์.
- นิภาพร สอนองบุญ. 2548. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนและดัชนีราคาภายใต้ระบบอัตราแลกเปลี่ยนลอยตัวของประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- นันทน์ภัส. 2553. ความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยน. แหล่งที่มา :  
<http://learners.in.th/file/nunnapat123>
- นิฐิตา เบญจมสุทิน และ นงนุช พันธกิจไพบูลย์. 2547. เศรษฐศาสตร์ระหว่างประเทศ **International Economics**. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์แห่งจุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- พรายพล คู่มิตรพิชัย. 2547. เศรษฐศาสตร์การเงินระหว่างประเทศ: ทฤษฎีและนโยบาย. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- พิสิฐ ลือชาธรรม. 2551. เศรษฐกิจไทยกับความเสี่ยงในทิศทางการพัฒนาเศรษฐกิจมหภาค การเงินการคลัง เล่ม 3. กรุงเทพฯ: คณะทำงานเศรษฐกิจมหภาค การเงินการคลัง สถาบันปริกษาเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ
- รัตนา เฉลียว. 2549. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลต่อการกำหนดอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อนัสปริย์ ไชยวรรณ. 2546. การประยุกต์ใช้โคอินทีเกรชั่น และแบบจำลองเอเรอร์คอร์เรคชั่น กับอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศในภูมิภาคเอเชีย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อภิสิทธิ์ สรรพดิลก. 2547. การส่งผ่านความไม่แน่นอนของปัจจัยที่มีผลในตลาดซื้อขายไฟฟ้าจากประสบการณ์ของต่างประเทศโดยใช้วิธีแบบจำลอง MULTIVARIATE GARCH. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

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 Business Economics Statistics** 18: 10-17.

Choudhry, Taufiq. 2005. "Exchange Rate volatility and the United States export: evidence from Canada and Japan." **Journal of The Japanese and Internation Economies** 19: 51-71.

Bollerslev, Engle and Wooldridge. 1988. "Generalized autoregressive conditional heteroskedasticity" **Journal of Econometrics** 31: 307-327.

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.

Grobal 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.
- MacDonald, R. and Taylor, M.P. 1995. "The monetary model of the exchange rate : Long-Run relationship, Short-Run dynamic and how to beat a random walk." **Journal of International Money and Finance** 13: 276-290.
- 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.