เอกสารอ้างอิง

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

พรายพล คุ้มทรัพย์. 2547. **เศรษฐศาสตร์การเงินระหว่างประเทศ: ทฤษฎีและนโยบาย**. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

พัชนียา พัชนีรัตนกรณ์. 2552. **ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยน และ ความผันผวนของการนำเข้าน้ำมันดิบของประเทศไทย.**เชียงใหม่: การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

พิจิตต์ อินตา. 2551. **การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราเงินเฟ้อกับอัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของประเทศไทย ด้วยแบบจำลองไบวาเรจการ์ช**. เชียงใหม่: การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ภาคิน จิตโภคเกษม. 2550. **ผลกระทบของความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนต่อระดับราคาสินค้าในประเทศไทย.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

รัตนา สายคณิต. 2539. **เศรษฐศาสตร์มหภาค.** พิมพ์ครั้งที่ 1. กรุงเทพฯ: ไทยวัฒนาพานิช.

สรศักดิ์ บุญมี. 2540. **การสนองตอบของสินค้าเข้าและสินค้าออกของไทยต่อการเปลี่ยนแปลงราคาและอัตราแลกเปลี่ยน.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยรามคำแหง.

อนัญญา กันตสุสิระ. 2531. **อิทธิพลของอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงต่อการส่งออกและการนำเข้า.** ภาคนิพนธ์คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันพัฒนบริหารศาสตร์.

อภิสิทธิ์ สรรพดิลก. 2547. **การส่งผ่านความไม่แน่นอนของปัจจัยที่มีผลในตลาดซื้อขายไฟฟ้าจากประสบการณ์ของต่างประเทศโดยใช้วิธีแบบจำลอง MULTIVARIATE GARCH.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

อารยา กาญจนธารากุล. 2551. **ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของปริมาณการส่งออกและความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศไทย**. เชียงใหม่: การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

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

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

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.

Edwards, Sebastain, (1999) "**How Effective are Capital Controls?**" , National Bureau of Economic Research, Working Paper 7413, November

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.

Matteo Manera & Alessandro Lanza & Michael McAleer, 2004. "**Modelling Dynamic Conditional Correlations in WTI Oil Forward and Futures Returns**," Working Papers 2004.72, Fondazione Eni Enrico Mattei

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.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved