

## เอกสารอ้างอิง

กฤษฎา พงษ์ประพันธ์. 2553. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราผลตอบแทนจากดัชนีราคาสินค้าโภคภัณฑ์ของจิมโรเจอร์ และดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยใช้แบบจำลองวาร์มาการซ์ และวาร์มาเอการซ์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ชนานูช จันทรา. 2552. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับอัตราผลตอบแทนของดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธีไบวาร์ริเอทการซ์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ฐิติศักดิ์ กิตติศักดิ์ธาดากุล. 2552. ผลกระทบความผันผวนของเงินเฟ้อและอัตราแลกเปลี่ยนต่อความผันผวนของจำนวนนักท่องเที่ยวต่างชาติที่เข้ามาท่องเที่ยวในประเทศไทยโดยวิธี มัลทิวาริเอทการซ์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ณพล หงสกุลวสุ. 2550. ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนและการเคลื่อนย้ายทุนของประเทศในเอเชีย. วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ณิษา พุศรีนวล. 2552. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราเงินเฟ้อและอัตราดอกเบี้ยของประเทศไทย. วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. “เศรษฐมิติ : ทฤษฎีและการประยุกต์.” เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2553. สถิติตลาดการเงิน (อัตราแลกเปลี่ยน). แหล่งที่มา:

<http://www.bot.or.th/Thai/Statistics/FinancialMarkets/ExchangeRate/Pages/index.aspx>

นนทลี ศรีสว่าง. 2552. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราเงินเฟ้อและการว่างงานของประเทศไทย โดยวิธีไบวาร์ริเอทการซ์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

นาถลดา กำลั้งเสื่อ. 2550. นโยบายอัตราแลกเปลี่ยนศึกษาตามแนวคิดความกดดันของอัตราแลกเปลี่ยน. วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

พชันีชา พชันีรัตน์กรณ. 2552. ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนและความผันผวนของการนำเข้าน้ำมันดิบของประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

มหาวิทยาลัยรามคำแหง. 2553. ทฤษฎีการกำหนดอัตราแลกเปลี่ยน. [ออนไลน์]. แหล่งที่มา:

<http://e-book.ram.edu/e-book/e/EC353/EC353-3.pdf>

ยวตฤทธิ์ เขียรตะวัน. 2540. เงินทุนเคลื่อนย้ายจากต่างประเทศและอัตราแลกเปลี่ยนที่แท้จริงของประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัย จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

วิษณุพล มังคลาภิวฒัน. 2553. การวิเคราะห์อัตราผลตอบแทนของราคาทองคำล่วงหน้าเปรียบเทียบกับดัชนีกลุ่ม 50 หลักทรัพย์ล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์แห่งประเทศไทยโดยใช้วิธีจำลองทวาริเอทการ์ช. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

อัครพงศ์ อันทอง. 2550. “คู่มือการใช้โปรแกรม EViews เบื้องต้น: สำหรับการวิเคราะห์ทางเศรษฐมิติ: เอกสารประกอบการการใช้โปรแกรม.” เชียงใหม่: สถาบันวิจัยสังคม มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

Aggarwal, R. 1981. “Exchange Rate and Stock price Interactions in Emerging Financial Market: Evidence on India, Korea, Pakistan, and Philippines.” **Applied Financial Economic** 7, 25-35.

Bollerslev, T. 1986. “Generalized autoregressive condition heteroscedasticity.” **Journal of Economics** 31: 307-327.

Dickey, D. A. and Fuller, W. A. 1981. “Likelihood ratio statistic for autoregressive time series with a unit root.” *Econometrics* 49. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิติ : ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

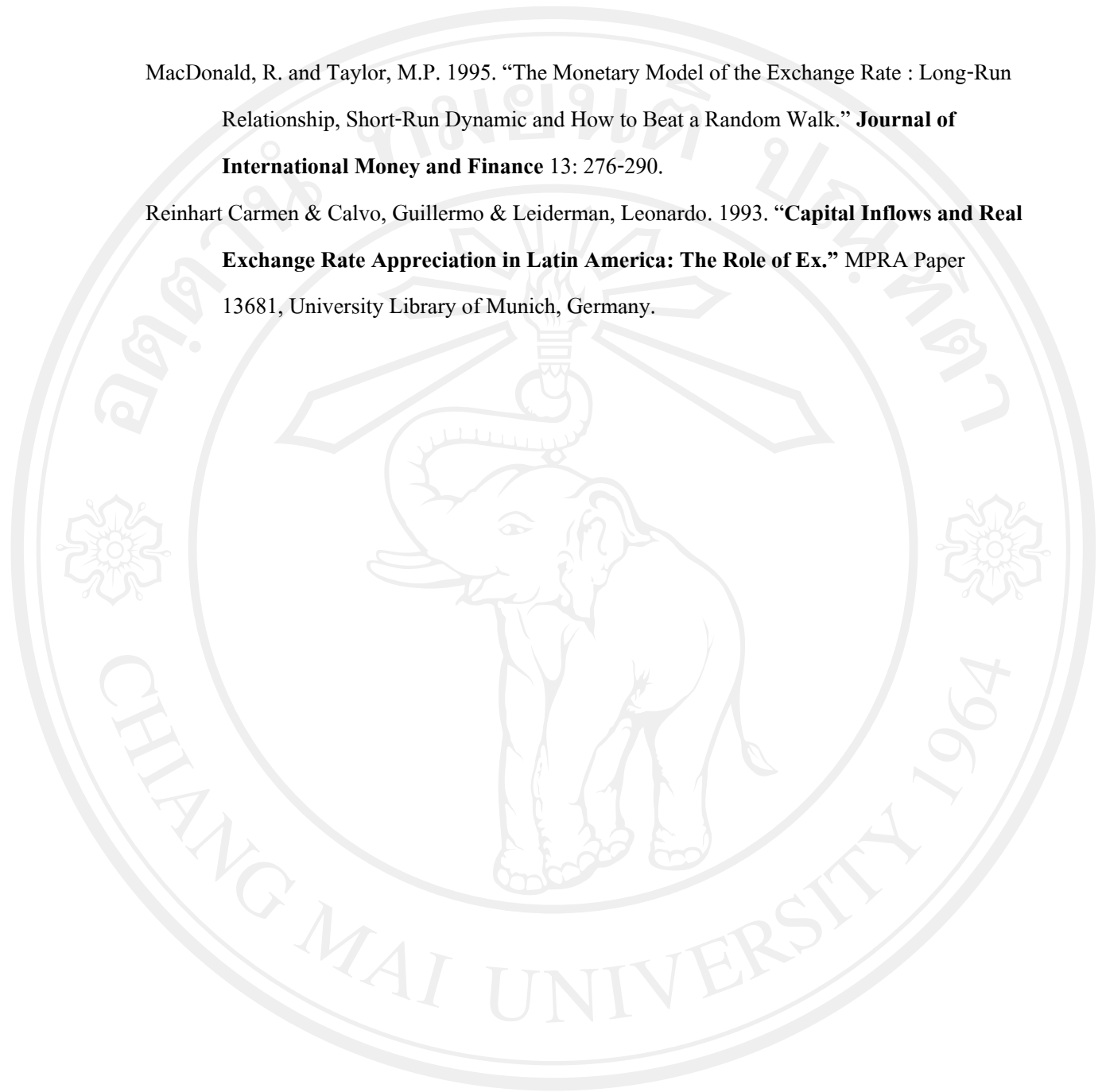
Ender, Walter. 2004. **Applied Econometric Time Series**. Second edition. New York: John Wiley and sons.

Engle, R.F. 2002. “Dynamic conditional correlation: anew simple class of multivariate GARCH models.” **Journal of Business and Economic Statistic** 20: 339-350.

Frederic S. Mishkin. 2003. “The Foreign Exchange Market, Theory of Rational Expectations and Efficient Capital Markets.” **The Economics of Money, Banking, and Financial Markets** 7: 151-177, 27: 691-714.

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.

Reinhart Carmen & Calvo, Guillermo & Leiderman, Leonardo. 1993. "**Capital Inflows and Real Exchange Rate Appreciation in Latin America: The Role of Ex.**" MPRA Paper 13681, University Library of Munich, Germany.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
Copyright© by Chiang Mai University  
All rights reserved