

บรรณานุกรม

ภาษาไทย

- กิตติ ถิ่นสกุล. “แบบจำลองเศรษฐกิจมหภาคและการพยากรณ์ภาวะเศรษฐกิจในประเทศไทย.” สถาบันวิจัยสังคมและคณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2529.
- กัญสุคา ถิ่นพิพัฒน์ชัย. “แบบจำลองเชิงเศรษฐมิติสำหรับ ภาคการผลิต ตลาดแรงงาน และระดับราคาของประเทศไทย.” วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- คณิงอุษ นพคุณ. “แบบจำลองเศรษฐมิติ สำหรับอธิบายความจำเรื้อยเติบโตทางเศรษฐกิจของประเทศไทย.” วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตร์มหาบัณฑิต(เศรษฐศาสตร์) มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์, 2524.
- จิตรา อุไรรัมย์. “ผลของการกีดกันต่างประเทศของภาคเอกชน และภาครัฐบาลที่มีต่อการออมและการเจริญเติบโตของเศรษฐกิจของประเทศไทย.” วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตร์มหาบัณฑิต (เศรษฐศาสตร์) มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์, 2541.
- ชลีย์พร อมรวัฒนา. เศรษฐศาสตร์มหภาค. พิมพ์ครั้งที่ 2 จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2539.
- ชาติเฉลิม สุรชัยชาญ. “การวิเคราะห์ทางเศรษฐกิจของผลกระทบของนโยบายเศรษฐศาสตร์มหภาคที่มีต่อตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และตัวแปรทางเศรษฐกิจ.” วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตร์มหาบัณฑิต (เศรษฐศาสตร์ธุรกิจ) มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์, 2541.
- ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์กุล. “แบบจำลองเศรษฐมิติสำหรับภาครัฐบาลของประเทศไทย.” วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. “พฤติกรรมการณ์ส่งผ่านราคาทุ้ทุ่การค้าระหว่างตลาดค้าส่งโตเกี่ยวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 3 (กันยายน-ธันวาคม 2542): 16-51.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. รายงานเศรษฐกิจรายเดือน., มกราคม 2508- เมษายน 2544.
- นิรันดร์ วิศเวศวร. “แบบจำลองการเคลื่อนไหวของอัตราแลกเปลี่ยน.” วารสารเศรษฐศาสตร์ธรรมศาสตร์, 14 (มีนาคม 2539): 23-47.
- บัณฑิต ชัยวิชญชาติ. “ลักษณะและปัจจัยที่กำหนดการลงทุนจากต่างประเทศในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.” วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2539.

- บุญชัย เกียรติธนาวิทย์. “ปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีอิทธิพลต่อราคาหุ้นกลุ่มธนาคารพาณิชย์ และบริษัท
เงินทุนและหลักทรัพย์.” วิทยานพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์,
2534.
- มานะ เลิศสกุลบรรลือ. “ปัจจัยที่กำหนดการลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศในไทย.” วิทยานพนธ์
เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2539.
- พรรณงาม อารยวุฒิ. “หนี้ต่างประเทศและการบริหารนโยบายเศรษฐกิจมหภาคของไทย.”
วิทยานพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2533.
- พอล โสคกิจการ. “แบบจำลองเศรษฐกิจมหภาคเพื่อใช้ในการวางแผนพัฒนาเศรษฐกิจสำหรับ
ประเทศไทย.” วิทยานพนธ์วิทยาศาสตร์มหาบัณฑิต (เศรษฐศาสตร์) มหาวิทยาลัย
เกษตรศาสตร์, 2530.
- ไพฑูรย์ ไกรพรศักดิ์. “บทบาทของการขยายตัวด้านผลิตภาพปัจจัยการผลิตโดยรวมในเศรษฐกิจ
ไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ธรรมศาสตร์, 16 (มิถุนายน 2541): 5-54.
- ไพโรจน์ อารีประเสริฐ. “แบบจำลองเศรษฐกิจประเทศไทยเพื่อประเมินผลนโยบายการคลัง และ
นโยบายการเงิน : 1970(1)-1984(4).” วิทยานพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์
มหาวิทยาลัย, 2531.
- กาญจนา นธิประภา, ทวีวรรณ สิทธิเดช และจิราภา อินธิแสง. “การสร้างแบบจำลองพยากรณ์ภาวะ
เศรษฐกิจระยะสั้น.” สถาบันวิจัยเพื่อการพัฒนาประเทศไทย, 2541.
- รังสรรค์ หทัยเสรี. “Cointegration and Error Correction Approach : ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์
ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ธรรม
ศาสตร์, 13 (กันยายน 2538): 20-55.
- รัชพงษ์ ปดิฐพร. “แบบจำลองเศรษฐกิจมหภาคสำหรับภาคตะวันออกเฉียงเหนือของไทย.” วิทยา
นพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2533.
- ศราวุฑู วิโรจน์รัตน์. “การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลกระทบต่อราคาหลักทรัพย์ไทย.” วิทยานพนธ์วิทยา
ศาสตร์มหาบัณฑิต (เศรษฐศาสตร์) มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์, 2539.
- สุชาติ ราคารังวษ. “แบบจำลองเศรษฐกิจมหภาคที่มีคุณภาพโดยทั่วไปสำหรับประเทศไทย.”
คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยรามคำแหง, 2527.
- สุนทรี กัลยาณพิเศษ. “การตัดสินใจลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยใช้แบบจำลอง
Arbitrage Pricing Theory (APT).” วิทยานพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัย
เชียงใหม่, 2539.

- สุวิมล ชูติจิรนาท. “ปัจจัยที่มีผลต่อดัชนีราคาหลักทรัพย์ไทย.” วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต (เศรษฐศาสตร์ธุรกิจ) มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์, 2540
- แสงนภา รังคศิริ. “ปัจจัยกำหนดเงินทุนไหลเข้าจากต่างประเทศของประเทศไทย.” วิทยานิพนธ์ศิลปศาสตรมหาบัณฑิต (เศรษฐศาสตร์และการเงินระหว่างประเทศ) จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2539.
- สำนักงานคณะกรรมการพัฒนาการเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ. “สต็อกทุนของประเทศไทย ปี 2513-2519.”, 2541.
- อมรา ศรีพิชัย และคณะ. “แบบจำลองนโยบายการเงินภายใต้กรอบ Inflation Targeting”, ธนาคารแห่งประเทศไทย, 2544.

ภาษาอังกฤษ

- Chaipravat, O., Meesook, K. and Garnjarende, S. “Impacts of Monetary, Fiscal, Debt Management and Exchange Rate Policy Changes in the Thai Economy, A Macroeconometric Model Simulation.” Department of Economic Research Bank of Thailand, 1977.
- Charl Kengchon. Thailand’s Perspective on Foreign Loans. TDRI, June 1995.
- Charemza, Wojciech W. and Deadman, Derek F. **New Directions in Econometric Practice: General to Specific Modeling, Cointegration and Vector Autoregression.** Cambridge University Press, 1992.
- Clarida, Richard H. and Taylor, Mark P. “The term structure of forward exchange premiums and the forecastability of spot exchange rates: correcting the errors.” **The Review of Economics and Statistics**, (August 1997): 353-361.
- Clark, J.S. and Youngblood, C.E. “Estimating Duality Models with Biased Technical Change: A Time Series Approach.” **American Journal of Agricultural Economics**, (May 1992): 353-360.
- Enders, W. **Applied Econometric Time Series.** New York: John Wiley & Sons, Inc., 1995.
- Engle, Robert F. and Granger C. J. W. “Co-integration and Error Correction: Representation, Estimation, and Testing.” **Econometrica**, 55 (March 1987): 251-276.
- Evans and Sann. “Testing of Unit roots : P”. **Econometrica**, 49 (May 1981): 753-779.

- Gujarati, Damodar N. **Basic Econometric**. Singapore: McGraw-Hill, 1995.
- Gülen, S.G. "Is OPEC? Evidence from Cointegration and Causality Tests." **Department of Economics Boston College**, (May 1996).
- Hall, S.G. and Henry, S. G. B. "Macroeconomic Modeling.", Elsevier Science Publisher, 1988.
- Hang, Alfred A., Mackinnon, James G., and Michelis, L. **European Monetary Union: A Cointegration Analysis**. April 1999.
- Harris, R.I.D. **Using Cointegration Analysis in Econometric Modeling**. Great Britain: T.J. Press(Padstow) Ltd., 1995.
- Hataiseree, R. "Vector Autoregression, Unit Roots, Cointegration and Error-Correction Mechanisms: A General Overview." **Chulalongkorn Journal of Economics**, 8 (May 1996) : 263-294.
- _____. "The demand for money in Thailand: Cointegration and Error-Correction Approaches." **The Singapore Economic Review**, 38: 195-230.
- Hirunya Mukhopadhyay. "Private Investment and External Debt: the Debt Overhang Hypothesis Revisited." Institute for Economic Development. Boston University, July 1995.
- Hoffman, D.L. and Rasche R.H. 1997. "STLS/US-VECM 6.1 : A Vector Error-Correction Forecasting Model of the U.S. Economy" , Working Paper 97-008A, Federal Reserve Bank of ST. Louis.
- Itharattana, Kajonwan P. "Macroeconometric model of the Thai economy." Ph.D.Dissertation Iowa State University, 1981.
- Jack Clark Francis. **Investment Analysis and Management**. 5th Edition. McGraww-Hill,1991.
- Johansen, S. "Estimation and Hypothesis Testing of Cointegration Vectors in Gaussian Vector Autoregressive Models." **Econometrica**, 59 (November 1991): 1551-1580.
- _____. "Statistical analysis of Cointegration vectors". **Journal of Economic Dynamics and Control**, 12 (1988): 231-254.
- Johansen, S. and Juselius, K. "Maximum Likelihood Estimation and Inference on Cointegration- with Applications to the Demand for Money." **Oxford Bulletin of Economics and Statistics**, 52 (1990).
- Johnston, J. and Dinardo, J. **Econometric Methods**. Singapore: McGraw-Hill, 1997.
- Junankar, P. N. **Investment: Theories and Evidence**. The Anchor Press Ltd., 1972.

- Karfakis, C. "The Demand for International Liquidity: A Cointegration Approach." **Applied Financial Economics**, 7 (1997): 673-678.
- Liu, P. and Tanner, E. "Intertemporal Solvency and Breaks in the US Deficit Process: A maximum-Likelihood Cointegration Approach". **Applied Economics Letters**, 2 (1995): 231-235.
- Maddala, G.S. and In-Moo Kim. **Unit Roots Cointegration and Structural Change**. United Kingdom : Cambridge University Press, 1998.
- McCafferty, S. **Macroeconomic Theory**. New York: Harper & Row, Publishers, Inc., 1990.
- Mullikamas, S., Mallikamas T. and Watunyata, P. "Impact of Foreign Equity Investment on Thailand's Financial Market." **F-1 Portfolio Investment and Stock Market**. The 5th Conventional of the East Asian Economic Association in Bangkok, Thailand. October 25-26, 1996.
- Nijathaworn, B. and Arya, G. **An Econometric Model for Thailand Under The Link System Final Report**, Faculty of Economics Thammasat University February 1987.
- Pindyck, Robert S. and Rubinfeld, Daniel L. **Econometric Models and Economic Forecasts**. Singapore: McGraw-Hill, 1998.
- Ramangkura, V. "A Macroeconometric Model for Thailand: A Classical Approach, from Finance, Trade and Economic Development in Thailand." Bank of Thailand, 1975.
- Ruangwud Jarurungsipong. "Macroeconomic Aspect of Foreign Direct Investment in Thailand." Master of Economics. Thammasat University, May 1996.
- Sargent, Thomas J. **Macroeconomic Theory**. Academic Press, Inc., 1979.
- Turnovsky, Stephen J. **Macroeconomic Analysis and Stabilization Policy**. Cambridge University Press, 1977.
- _____. **International Macroeconomic Dynamics**. The MIT Press, 1997.
- Wisarn Puphavesa. and Bunluasak Pussarungsri. "FDI in Thailand." International Economic Relations Program. TDRI, April 1994.
- Weliwita, A. and Ekanayake, E. M. "Demand for money in Sri Lanka during the post-1977 period: a cointegration and error correction analysis". **Applied Economics**, 30 (1998): 1219-1229.

Wolters, J. "Cointegration and German bond yield". *Applied Economics Letters*, 5 (1998): 497-502.

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Chiang Mai University