

เอกสารอ้างอิง

- กมลวรรณ คำแก้ว. 2548. แบบจำลองทางการเงินสำหรับการกำหนดอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เถลิงศักดิ์ นุชประหาร. 2542. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อการกำหนดอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตี: ทฤษฎีและการประยุกต์. มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ธรรมรักษ์ หมั่นจักร์. นโยบายการเงิน : หลักทฤษฎีและหลักปฏิบัติ. กรุงเทพฯ: จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2547.
- นิธินันท์ วิศเวศวร. 2539. “แบบจำลองการเคลื่อนไหวของอัตราแลกเปลี่ยน.” วารสารเศรษฐศาสตร์ธรรมศาสตร์ 14, 1(มีนาคม): 23-47.
- ประเจิด สิ้นทรัพย์. 2527. เศรษฐศาสตร์มหภาคเบื้องต้น. กรุงเทพฯ: ไทยวัฒนาพานิช.
- รักชนก นุชพงษ์. 2540. ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนและส่วนต่างของอัตราดอกเบี้ยที่แท้จริง. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต. มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- รังสรรค์ หทัยเสรี. 2538. “Cointegrate and Error Correction Approach : ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ธรรมศาสตร์ 13, 3 (กันยายน): 20-55.
- สมชัย สัจจพงษ์และอดิศร สวัสดิ์พาณิชย์. 2542. “สัญญาณเดือนกัปปัญหาระบบสถาบันการเงิน.” จุลสารเศรษฐกิจการคลัง สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง น. 6 (มิถุนายน): 1-3.
- สุรศักดิ์ พิษิตผองกิจและสมชัย สัจจพงษ์. 2542. “สัญญาณเดือนกัปปัญหาระบบสถาบันการเงิน.” จุลสารเศรษฐกิจการคลัง สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง น. 6 (มิถุนายน): 1-2.

สายสุดา จันทรา. 2547. ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศกับดัชนีตลาดหลักทรัพย์บางประเทศในเอเชีย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต. มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

อัครรา วงศ์จิตร. 2546. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจและการส่งออกของประเทศไทย อินโดนีเซีย มาเลเซีย และเกาหลีใต้. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

Bagchi, Debabrata.; Chortareas, Georgios E. and Miller, Stephen M. 2003. “The Real Exchange Rate in Small Open developed Economies.” **Bank of England Working Paper**. (June): 2003-2027.

Baxter, Mariannce. 1994. “Real Exchange Rate and Real Interest Differential : Have we missed the Bussiness – Cycle Relationship?.” **Journal of Monetary Economics**. 33 : 5-37.

Cambell, John Y. and Clarida, Richard H. 1987. “The Dollar and Real Interest Rate.” **Carnegie-Rochester Conference Series on Public Policy**. No. 27: 103-140.

Chacholiades, M. 1990. **International Economics**. Madrid. McGraw-Hill: 1992.

Chortareas, Georgios E. and Driver, Rebecca L. 2001. “PPP and the Real Exchange Rate Real Interest Rate Differential Puzzle Revisited : Evidence From Nonstationary Panel Data.” **Bank of England Working Paper**. No. 138.

Dickey, David A. and Fuller, Wayne A. 1979. “**Distribution of the estimators for autoregressive time series with a unit root.**” *American Statistics*, Associated 74: 427– 431.

Dickey, David A. and Fuller, Wayne A. 1981. “Likelihood Ratio Statistics for Autoregressivetime Series with a Unit Root.” **Econometrica** 49: 1057–1072.

Dornbusch, R. 1976. “Expectation and Exchange Rate Dynamics.” **Journal of Political Economy** 84 : 1161-1167.

Edison, H. J. and Pauls, D. B. 1993. “A Re-Assessment of the Relationship between Real Exchange Rates and Real Interest Rates: 1974–1990.” **Journal of Monetary Economics** 31 (April): 165–187.

Enders, W. 1995. **Applied Economics Time Series**. New York: John Wiley and Sons.

- Engle, Robert F. and Granger, C. W. J. 1987. "Cointegration and Error Correction : Representation Estimation and Testing ." **Econometrica** 55: 251–276.
- Filosa, Renato. 2004. "Monetary and Real shocks, the Business Cycle and the Value of the Euro." **Bank for International Settlements** No. 154. (June): 1-9.
- Franke, G. ; Olsen R. and Pohlmeier, W. 2002. **Overview of Forecasting Models**. Seminar on Frequency Finance. Konstanz. Associates Switzerland.
- Frankel, J A. 1979. "On the Mark : A Theory of Floating Exchange Rates Based on Real Interest Differentials." **American Economic Review** 69, 4: 610-622.
- Gruen, D. W. R. and Wilkinson, J. 1994. "Australia's Real Exchange Rate – Is it explain by The Terms or by Real Interest Differentials?." **Economics Record** 70: 204-219.
- Gujarati, D. N. 1995. **Basic Economics**. 3rd ed. Singapore: McGraw-Hill.
- Hoffmann, M. and MacDonald, R. 2000. "A Real Differential View of Equilibrium Real Exchange Rates and Misalignments." **Center for Financial Studies Working Paper** 8 (July).
- Johansen, S. 1988. Statistical Analysis of Cointegration Vector. **Journal of Economic Dynamics and Control** 12, 2-3 (June-September): 231-254.
- Johansen, S. and Juselius, K. 1990. "Maximum Likelihood Estimation and Inference on Cointegration - With Applications to the Demand for Money." **Oxford Bulletin of Economics and Statistics** 52, 2: 169-210.
- Kaminsky, G. and Reinhart, C. 1998. Financial Crises in Asia and Latin American: Then and Now. **American Economics Review** 88, 2 (May): 444 - 448.
- Kanas, A. 2005. "Modelling The US/UK Real Exchange Rate –Real Interest Rate Differential Relation: A Multivariate Regime Switching Approach." **The Manchester school** 73, 2 (March): 123.
- MacDonald, R. and Nagayasu, Jun. 1999. **The Long - Run Relationship Between Real Exchange Rates and Real Interest Rate Differentials**. Washington, D C: **International Monetary Fund**. (IMF Working Paper, 37)
- Masahiro, Kawai. and Hidetaka, Ohara. 1997. "Nonstationarity of Real Exchange Rates in the G7 Countries : Are They Cointegrated with Real Variables?." **Journal of Economic Literature Classification** No. F31, F32: 138-145.

- Meese, R. and Rogoff, K. 1988. "Was it real ? the Exchange Rate Interest Differential Relation over the Modern Floating-rate Period." **Journal of Finance** 38, 4 (September): 933-948.
- Krugman, P. R. 1996. **International Economics : Theory and Policy**. 6th ed. Madrid. Pearson Edition.
- Rogoff, K. 1996. "The Purchasing Power Parity Puzzle." **Journal of Economic Literature** 34: 647-668.
- Taghavi, Majid and Sun, Yu Hua. 2002. "Real Exchange Rates and Real Interest Rate Parity : The Case of China." **Economics and Resource Management** 2, 45 (December): 152-154.