

เอกสารอ้างอิง

- กมลวรรณ คำแก้ว. 2548. แบบจำลองทางการเงินสำหรับการกำหนดอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของไทย. เชียงใหม่: วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จุฑาภรณ์ เวชมนัส. 2552. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับราคาหลักทรัพย์ของกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. เชียงใหม่: หัวข้อและโครงร่างเพื่อทำการค้นคว้าแบบอิสระ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ชาลินี แสนนรินทร์. 2550. ผลกระทบของอัตราแลกเปลี่ยนที่มีต่อมูลค่าสินค้าส่งออกที่แท้จริงของประเทศไทยไปยังสหรัฐอเมริกา. เชียงใหม่: วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- พิจิตต์ อินตา. 2551. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราเงินเฟ้อกับอัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของประเทศไทย ด้วยแบบจำลองโบวาเรจการ์ช. เชียงใหม่: การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตี: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตี: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ อ้างถึงใน สธนพล วิเชียรรัตนพันธ์. 2547. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการ์ชเอ็ม: กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. “พฤติกรรมกรรมการส่งผ่านกึ่งกลางค้าระหว่างตลาดค้าส่งโตเกียวกับตลาดผู้ค้าบรรจู่ในประเทศไทย” วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 3: 16-51
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2552. สถิติตลาดการเงิน (อัตราแลกเปลี่ยน). แหล่งที่มา: <http://www.bot.or.th/Thai/Statistics/FinancialMarkets/ExchangeRate/Pages/index.aspx> (8 มิถุนายน 2552)

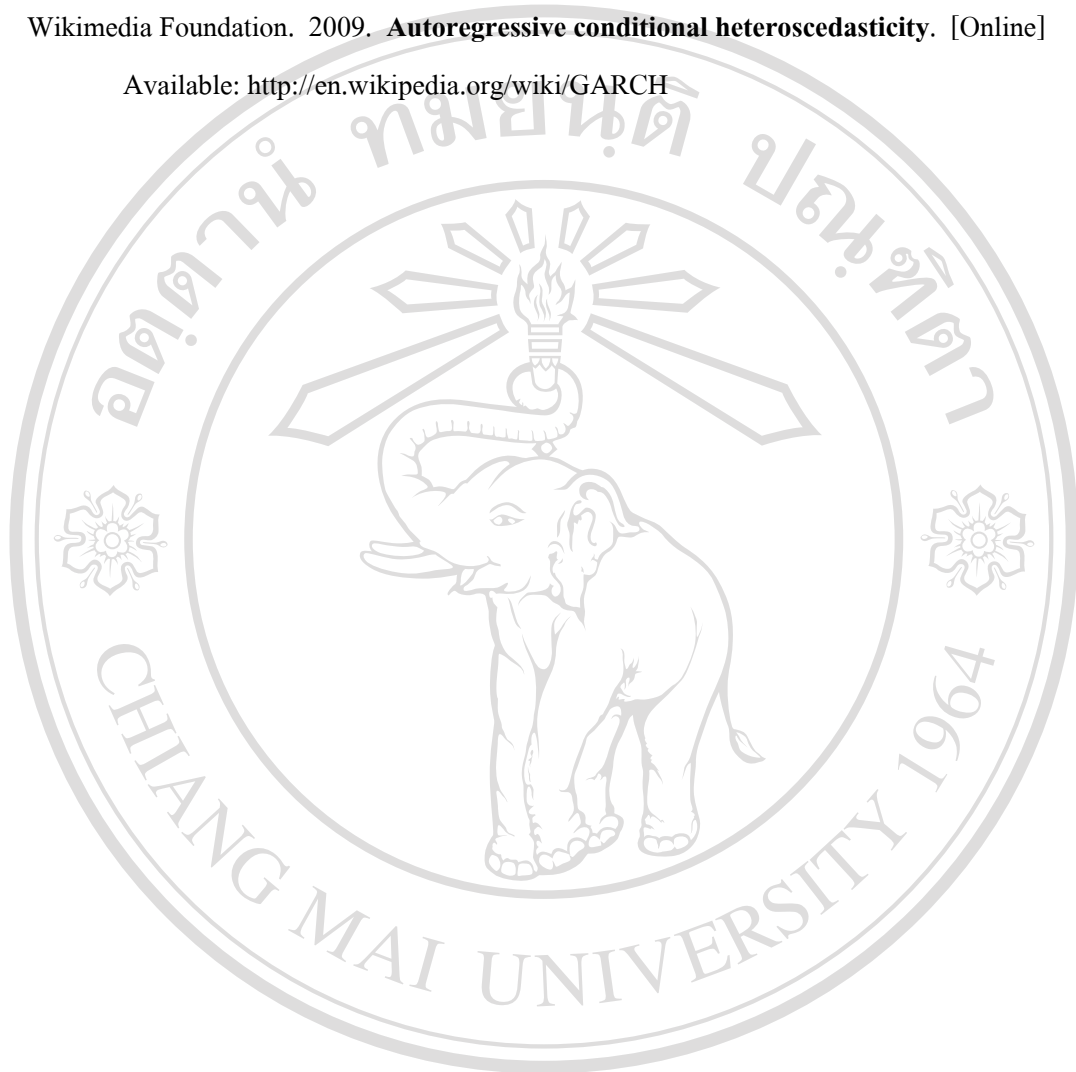
- นฤมล เชาวนีวิทยางกูร. 2542. ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนในตลาดแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ กับตลาดหลักทรัพย์. เชียงใหม่: วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สายสุดา จันทรา. 2547. ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศกับดัชนีราคาหลักทรัพย์บางประเทศในเอเชีย. เชียงใหม่: การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. 2531. การวิเคราะห์หอนุกรมเวลา. มหาสารคาม : คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ.
- อารยา กาญจนธรรากุล. 2551. ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของปริมาณการส่งออกและความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศไทย. เชียงใหม่: การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต 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 Conditional Heteroscedasticity." **Journal of Econometrics** 31: 307-327
- Choudhry, Taufiq. 2005. "Exchange rates volatility and the United States export: evidence from Canada and Japan." **Journal of the Japanese and International Economies** 19: 51-71.
- Dickey, D. A. and Fuller, W. A. 1981. "Likelihood ratio statistic for autoregressive time series with a unit root" *Econometrica* 49. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์**. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Engle, R. F. 2002. "Dynamic conditional correlation: a new simple class of multivariate GARCH models." **Journal of Business and Economic Statistics** 20: 339-350
- Frederic S. Mishkin. 2001. "The transmission mechanism and the role of asset prices in monetary policy." **NBER Working Paper**, No 8617.
- 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.
- Kruger, A. O. 1983. **Exchange Rate Determination** Cambridge: Cambridge University Press

The Stock Exchange of Thailand. 2009. **SET Market Analysis and Reporting Tool**. [Online]

Available: <http://www.setsmart.com>

Wikimedia Foundation. 2009. **Autoregressive conditional heteroscedasticity**. [Online]

Available: <http://en.wikipedia.org/wiki/GARCH>



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved