

เอกสารอ้างอิง

- โชคิชัย สุวรรณภรณ์. 2551. **วิกฤตการณ์ Subprime ของสหรัฐ และผลกระทบต่อประเทศไทย.**
[ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา: <http://www.nidambe11.net/ekonomiz/2008q1/2008February22p2.htm>
- จิตติมา ศรีจันทร์พานิช. 2538. **ผลกระทบการปรับอัตราดอกเบี้ยธนาคารกลางสหรัฐอเมริกาต่อดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.** ภาคนิพนธ์พัฒนบริหารศาสตรมหาบัณฑิต สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐกิจและการประยุกต์.** เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2547. **ประวัติและบทบาทหน้าที่ธนาคารแห่งประเทศไทย.**
[ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา: <http://www.bot.or.th/bothomepage/BankAtWork/AboutBot/Response/History/history-response.html>.
- นินนาท ชาญรัตน์สุทธิกุล กฤษณา หุตะเสรมณี และสุรศักดิ์ บุญประกอบ. 2534. **ตลาดการเงิน สถาบันการเงิน และนโยบายการเงิน หน่วยที่ 8-15.** กรุงเทพฯ: มหาวิทยาลัยสุโขทัยธรรมาธิราช.
- พิสิฐ ลี้อาธรรม. 2551. **เศรษฐกิจไทยกับความเสี่ยงในทิศทางการพัฒนาเศรษฐกิจมหภาค การเงิน การคลัง เล่ม 3.** กรุงเทพฯ: คณะทำงานเศรษฐกิจมหภาค การเงินการคลัง สถาบันปริกษาเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ
- ไพศาล พรเศรษฐเมธากุล. 2534. **อิทธิพลของการเปลี่ยนแปลงอัตราดอกเบี้ยต่างประเทศที่มีต่ออัตราดอกเบี้ยไทย.** ภาคนิพนธ์พัฒนบริหารศาสตรมหาบัณฑิต สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์.
- มุกิตา มากบุญ. 2546. **ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราดอกเบี้ยธนาคารกลางสหรัฐอเมริกากับอัตราดอกเบี้ยธนาคารกลางแห่งประเทศไทย.** สารนิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยรามคำแหง.
- สธนพล วิเชียรรัตนพันธ์. 2547. **การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการزشเอ็ม: กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- โสภณ พรโชคชัย. 2552. ผลกระทบวิกฤตทางการเงินสหรัฐต่อเศรษฐกิจโลก. กรุงเทพฯ: ศูนย์
ข้อมูลวิจัยและประเมินค่าอสังหาริมทรัพย์ AREA.
- อภิสิทธิ์ สรรพดิกล. 2547. การส่งผ่านความไม่แน่นอนของปัจจัยที่มีผลในตลาดซื้อขายไฟฟ้าจาก
ประสบการณ์ของต่างประเทศโดยใช้วิธีแบบจำลอง MULTIVARIATE GARCH.
วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- อลิตา วัฒนชัย. 2544. ความสัมพันธ์ของอัตราดอกเบี้ยที่แท้จริงระหว่างประเทศ. วิทยานิพนธ์
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- อักรพงศ์ อินทอง. 2546. คู่มือการใช้โปรแกรม EViewเพื่อการวิเคราะห์ Granger Causality Tests
และ Least Square Method. สถาบันวิจัยสังคมมหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- Bollerslev, Engle and Wooldridge. 1988. "Generalized autoregressive conditional
heteroskedasticity" **Journal of Econometrics** 31: 307-327.
- 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.
- Box, George, Jenkins, Gwilym M. and Reinsel, Gregory C. 1994. **Time series analysis:
forecasting and control**. 3rd ed. New York: Prentice-Hall.
- Dickey, D.A., and W.A, Fuller. 1981. "Likelihood ratio statistic for autoregressive time series
with a unit root" **Econometrica** 49. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิติ:
ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Edward, Sebastian. 1998. "Interest rate volatility, contagion and convergence : An empirical
investigation of the cases of Argentina Chile and Mexico" **Journal of Applied
Economics** 1: 55-86
- Ling, S. and McAleer, M. 2003. "Asymptotic theory for a vector ARMA-GARCH model"
Econometric Theory 19: 278-308.
- R.R. Johnson. **A Guide to Using EViews with Using Econometrics: A Practical Guide**.
University of San Diego, 2000.
- Wikimedia Foundation. 2009. **Autoregressive conditional heteroskedasticity**. [Online]
Available: <http://en.wikipedia.org/wiki/GARCH>.
- _____. 2008. **Autoregressive moving average model**. [Online] Available:
<http://www.w3c.org/TR/1999/REC-html401-19991224/loose.dtd>.