

รายการอ้างอิง

ภาษาไทย

- พรชัย ชูณหจินดา, 2546, การบริหารการเงินระหว่างประเทศ(International Financial Management), 4,000 เล่ม, ครั้งที่ 2, กรุงเทพฯ : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- อัษฎา ชันฉวีทย์, 2546, กลไกของตลาดการเงินในระบบเศรษฐกิจไทย, 3,000 เล่ม, ครั้งที่ 2, กรุงเทพฯ : อัมรินทร์พรินติ้งแอนด์พับลิชชิ่ง.

ภาษาอังกฤษ

- Alquist, R., and Chinn, M.D. 2006. Conventional and Unconventional Approaches to Exchange Rate Modeling and Assessment. NBER Working Paper. No.12481.
- Baillie, R.T, and Bollerslev, T. 1989. The Message in Daily Exchange Rates: A Conditional-Variance Tale. *Journal of Business & Economic Statistics*. 297-305.
- Balaban, E. 2004. Forecast Exchange Rate Volatility.[On-line]. Available: http://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract_id=494482&download=yes.
- Blanchard, O., Giavazzi, F., and Sa, F. 2005. "International Investors. the U.S. Current Account, and the Dollar." BPEA.
- Chaboud, A.P., and Wright, J.H. 2005. Uncovered Interest Parity: It Works, but not for Long. *Journal of International Economics* 66. 349-362.
- Cheung, Y.-W., and Chinn, M.D. 1999. Macroeconomic Implications of the Beliefs and Behavior of Foreign Exchange Traders. NBER Working Paper. No. 7417.
- Cheung, Y.-W., and Wong, C. 2000. A Survey of Market Practitioners's Views on Exchange Rate Dynamics. *Journal of International Economics* 51. 401-419.

- Cheung, Y.-W., Chinn, M.D., and Marsh, Y.W. 2000. How do UK-Based Foreign Exchange Dealers Think Their Market Operates?. **NBER Working Paper**. No. 7524.
- Chinn, M.D. and Meredith, G. 2005. Testing Uncovered Interest Parity at Short and Long Horizons during the Post-Bretton Woods Era. **NBER Working Paper**. No. 11077.
- Caballero, J.R., Farhi, E., and Gourinchas, P.O. 2006. An Equilibrium Model of Global Imbalance and Low Interest Rate. **NBER Working Paper**. No. 11996.
- Delong, J.B. 2005. Divergent Views on the Coming Dollar Crisis. **The Economists' voice** 2, Issue 5.
- Delong, J.B. 2006. "Bottom Dollar". Project Syndicate[On-line]. Available: <http://economistsview.typepad.com/economistsview/2006/05/index.html>.
- Diebold, F. 1989. Book Reviews. **Journal of International Economics** 27. 185-198.
- Dooley, M.P., Folkerts-Landau, D. and Garber, P. 2003. An Essay on the Revived Bretton Woods System. **NBER Working Paper**. No. 9971.
- Doroodian, K., and Caporale, T. 2001. Central Bank International and Foreign Exchange Volatility. **IAER**. No. 4
- Edwards S. 2005. Is the U.S. Current Account Deficit Sustainable? AND If Not, How Costly is Adjustment Likely to Be?. **NBER Working Paper**. No. 11541.
- Engel, C. 1996. The Forward Discount Anomaly and the Risk premium: A Survey of Recent Evidence. **Journal of Empirical Finance** 3. 123-192.
- Estrella, A., and Trubin, M.R. 2006. The Yield Curve as a Leading Indicator: Some Practical Issues. **Federal Reserve Bank of New York**. No. 5.

- Feldstein, M. 2006. The 2006 Economic Report of the President: Comment on Chapter One (The Year in Review) and Chapter Six (The Capital Account Surplus). **NBER Working Paper**. No. 12168.
- Flood, R.P., and Rose, A.K. 1999. Understanding Exchange Rate Volatility without the Contrivance of Macroeconomics. **Economic Journal** 109. 660-672.
- Flood, R.P., and Marion, N.P. 2000. Self-Fulfilling Risk Predictions: An Application to Speculative Attacks. **Journal of International Economics** 50. 245-268.
- Gagnon, J. 2005. **Should the dollar dive**[On-line]. Available:
<http://delong.typepad.com/sdj/2005/09/economistcom.html>.
- Gourinchas, P.O. and Rey, H. 2005. "International Financial Adjustment. **NBER Working Paper**. No. 11155.
- Gourinchas, P.O. and Rey, H. 2005(In progress). US External Adjustment: The Exorbitant Privilege?. **Mimeo, Princeton and Berkeley**.
- Groen, J.J.J. 1999. Long Horizon Predictability of Exchange Rates: Is it for Real?. **Emprical Economics** 24. 451-469.
- Greene, W.H. 2000. **Econometrics Analysis (fourth edition)**. New York: Prentice Hall.
- Gujarati, D.N. 2003. **Basic Econometrics (4th edition)**. McGraw-Hill.
- Hamilton, J. 1994. **Time Series Analysis**. Princeton: Princeton University Press.
- Hausmann, R., and Sturzenegger, F. 2006. Dark Matter Makes the U.S. Deficit Disappear. **CID Working Paper**. No.124.

- Hillebrand, E., and Schnabl, G. 2003. The Effects of Japanese Foreign Intervention: GARCH Estimation and Change Point Detection. **Japan Bank for International Corporation Institute Working Paper. No. 6.**
- Inci, A.C., and Lub, B. 2005(In Press). Currency Futures-Spot Basis and Risk Premium. **Journal of International Financial Markets, Institutions and Money.**
- Isidore, C. 2006. Americans spend every cent - and more[Online]. Available: http://money.cnn.com/2006/12/21/news/economy/savings_rate/index.htm?postversion=2006122116.
- Johansen, S. 1988. Statistic Analysis of Cointegration Vectors. **Journal of Economic Dynamics and Control 12. 231-254.**
- Jorgenson, D.W., Ho, M.S., and Stirob, J.K. 2004. Will the U.S. Productivity Resurgence Continue?. **Federal Reserve Bank of New York. No. 13.**
- Kash. 2005. A tale of two landing[On-line]. Available: <http://www.angrybear.blogspot.com/2005/03/tale-of-two-landings-part-i.html>.
- Krugman, P. 2006. Will there be a dollar crisis?[On-line]. Available: http://economistsview.typepad.com/economistsview/2006/04/krugman_will_th.html.
- Labonte, M. 2005. Is the U.S. Current Account Deficit Sustainable?. **CRS Report for Congress.**
- McCollum, B.T. 1996. **International monetary economics.** Oxford University Press.

- MacDonald, R., and Taylor, M. 1994. The Monetary Model of the Exchange Rate: Long-run Relationship. Short-run Dynamics and How to Beat a Random Walk. *Journal of International Money and Finance* 13. 276-290.
- MacDonald, R. 2000. Expectations Formation and Risk in Three Financial Markets: Surveying What the Surveys Say. *Journal of Economic Surveys* 14. 69-100.
- Obstfeld, M., and Rogoff, K. 2004. The Unsustainable US Current Account Position. *NBER Working Paper*. No. 10869.
- Obstfeld, M., and Rogoff, K. 2005. Global Current Account Imbalances and Exchange Rate Adjustments. *BPEA* 1.
- Poole, W. 2005. How Dangerous is the U.S. Current Account Deficit?[On-line]. Available:
<http://economistsview.typepad.com/economistsview/2005/11/index.html>.
- Poon, S. H., and Granger, C.W.J. 2003. Forecasting Volatility in Financial Markets: A Review. *Journal of Economic Literature*. 478-539.
- Rajan, R. 2005. Global Current Account Imbalance: Hard Landing or Soft Landing. conference paper. *Credit Suisse First Boston*.
- Richard, P., and Rey, H. 2005. The Determinants of Cross-Border Equity Flows. *Journal of International Economics*. forthcoming.
- Roach, S. 2005. The Boy who Called a Hard Landing[On-line]. Available:
http://economistsview.typepad.com/economistsview/2005/11/the_boy_who_cal.html.

Roubini, N., and Setser, B. 2004. **The US as a Net Debtor: The Sustainability of the US**

External Imbalances[Online]: Available:

(<http://pages.stern.nyu.edu/~nrroubini/papers/Roubini-Setser-US-External-Imbalances.pdf>).

Samuelson, R. 2006. **A Very Soft Fairy Tale Landing. Commentary. Washington Post.**

Sarantis, N. 2006. **Testing the Uncovered Interest Parity Using Traded Volatility. a Time-Varying Risk Premium and Heterogeneous Expectations. Journal of International Money and Finance 25. 1168-1186.**

Stock, J.H., and Watson, M. 1993. **A Simple Estimator of Cointegration Vectors in Higher Order Integrated Systems. Econometrica 61. 783-820.**

Valderrama, D. 2006. **The Exchange Rate-Consumer Price Puzzle. Economic Letter. San Francisco Fed.**

Wu, T. 2006. **Globalization's Effect on Interest Rates and the Yield Curve. Economic Letter. Dallas Fed 1. No. 9.**

ประวัติผู้เขียนวิทยานิพนธ์

นางสาววิหรรษา ศรีเมือง เกิดวันพุธที่ 12 พฤศจิกายน พ.ศ. 2523 เวลา 8.00 น. ที่โรงพยาบาลบ้านบึง อำเภอบ้านบึง จังหวัดชลบุรี สำเร็จการศึกษาชั้นมัธยมศึกษาตอนต้นจากโรงเรียนบ้านบึงมัญญวิทยาคารในปี พ.ศ. 2539 และสำเร็จการศึกษาชั้นมัธยมศึกษาปลาย(สายวิทย์-คณิต)จากโรงเรียนชลกันยานุกูลในปี พ.ศ. 2541 จากนั้นเข้าทำการศึกษาในคณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย และสำเร็จการศึกษาในระดับปริญญาตรีในหลักสูตรเศรษฐศาสตร์ บัณฑิต สาขา การเงิน จากคณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย ในปี พ.ศ. 2545 จากนั้นได้เข้าทำงานที่ธนาคารไทยพาณิชย์ ตำแหน่ง เจ้าหน้าที่การค้าต่างประเทศ ฝ่ายการค้าต่างประเทศ สาขาแหลมฉบัง จังหวัดชลบุรี ตั้งแต่วันที่ 24 เมษายน พ.ศ. 2546 ถึง วันที่ 15 มิถุนายน พ.ศ. 2546 หลังจากนั้นได้เข้าทำงานที่ธนาคารกสิกร สำนักงานใหญ่ ในตำแหน่ง เจ้าหน้าที่บริหารงานระบบ ฝ่ายบัตรเครดิต ตั้งแต่วันที่ 16 พฤษภาคม พ.ศ. 2546 ถึง วันที่ 31 พฤษภาคม พ.ศ. 2548 จากนั้นได้เข้าทำการศึกษาในระดับปริญญาโทในหลักสูตรเศรษฐศาสตร์ มหาลัย บัณฑิต คณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย ในปี พ.ศ. 2548