

รายการอ้างอิง

ภาษาไทย

- กรรณิการ์ ลิปตพัลลภ. การเงินระหว่างประเทศ. กรุงเทพฯ:มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์, 2532.
- เจริญ เจษฎาวัลย์. การบริหารเงินบาท&เงินสกุลต่างประเทศภายใต้ระบบค่าเงินบาทลอยตัว. พิมพ์ครั้งที่ 1. กรุงเทพฯ:บริษัท พอดี จำกัด, 2541.
- ปกรณ วิชยานนท์. เครื่องมือทางการเงินรุ่นใหม่และผลกระทบต่อนโยบายเศรษฐกิจ. พิมพ์ครั้งที่ 1. กรุงเทพฯ:สถาบันวิจัยเพื่อการพัฒนาประเทศไทย, 2534.
- ปรีชาติ ทองขุนดำ. ประสิทธิภาพตลาดปริวรรตเงินตราต่างประเทศล่วงหน้าของไทยโดยวิธี Cointegration และ Error Correction Model. วิทยานิพนธ์ปริญญาโทบริหารธุรกิจ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2539.
- รักชนก นุชพงษ์. ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนและส่วนต่างของอัตราดอกเบี้ยที่แท้จริง. วิทยานิพนธ์ปริญญาโทบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2540.
- รังสรรค์ ธีระพรพันธุ์. การบริหารนโยบายเสถียรภาพเศรษฐกิจในอนาคต. พิมพ์ครั้งที่ 1. กรุงเทพฯ:โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2541.
- รังสรรค์ นทัยเสวี. Cointegration and Error Correction Approach: ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของไทย. วารสารเศรษฐศาสตร์ธรรมศาสตร์ 13 กันยายน 2538: 20-55.
- ลลิตพันธุ์ พิริยะพันธุ์. ค่าพรีเมียมในการซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้าของไทย. วิทยานิพนธ์ปริญญาโทบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2536.
- วิจักขณ์ ศิริแสง. การบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนภายใต้ระบบลอยตัว. พิมพ์ครั้งที่ 1. กรุงเทพฯ:โรงพิมพ์เดือนตุลา, 2540.
- วัฒน์พร พึ่งบุญ ณ อยุธยา, พัชราวลัย ชัยปาณี. การเงินระหว่างประเทศ. กรุงเทพฯ:บริษัทพิมพ์, 2528.
- สนอง แซ่มรัมย์. ประสิทธิภาพตลาดปริวรรตเงินตราต่างประเทศของไทย. วิทยานิพนธ์ปริญญาโทบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2533.

ภาษาอังกฤษ

- Alexakis, Panayotis. and Apergis, Nicholas. ARCH effects and cointegration: Is the foreign exchange market efficient? Journal of Banking & Finance 20(1996):687-697.
- Baillie, Richard T., Lippens, Robert E. and McMahon, Patrick C. Testing rational expectations and efficiency in the foreign exchange market. Econometrica 51(May 1983):553-562.
- Boothe, Paul. and Longworth, David. Foreign exchange market efficiency tests: Implications of recent empirical Findings. Journal of International Money and Finance 5(1986):135-152.
- Caves, Douglas W. and Feige, Edgar L. Efficient foreign exchange markets and the Monetary approach to exchange rate Determination. The American Economic Review 70(March 1980):120-133.
- Domowitz, I. and Hakkio, Craig S. Conditional variance and the risk premium in the foreign exchange market. Journal of International Economics 19(1985):47-66.
- Engle, Robert F. Autoregressive conditional heteroscedasticity with estimates of the variance of United Kingdom inflation. Econometrica 50(July 1982):987-1007.
- Engle, Robert F. and Granger, C.W. J. Co-integration and Error Correction Representation, Estimation and Testing. Econometrica 55(March 1987):251-276.
- Engle, Robert F. and Yoo, Sam B. Forecasting and testing in Cointegrated system. Journal of Econometrics 35:143-159.
- Frenkel, Jacob A. Exchange rate, Prices and Money: lessons from the 1920's. The American Economic Review 70(May 1980):235-241.
- Gujarati, Domodar N. Basic Econometrics. Singapore: McGraw-Hill. 1995.

- Hakkio, Craig S. and Rush, Mark. Market efficiency and cointegration: an application to the sterling and deusmark Exchange markets. Journal of International Money and Finance 8(1989): 75-88.
- Hakkio, Craig S. and Rush, Mark. Cointegration: how short is the long run? Journal of International Money and Finance 10(1991): 571-581.
- Hsieh, David A. The statistical properties of daily foreign exchange rates : 1974-1983. Journal of International Economics 24(1988): 129-145.
- Levich, Richard M. International Financial Markets: Prices and Policies. USA : McGraw-Hill, 1998.
- Liu, Peter C. and Maddala, G. S. Rationality of survey data and tests for market efficiency in the foreign exchange markets. Journal of International Money and Finance 11(1992): 366-381.
- Messe, Richard A. and Singleton, K. J. On unit roots and the empirical modeling of exchange rates. Journal of Finance 37: 1029-1035.
- Mills, Terence C. The econometric modelling of financial time series. Great Britain : Atheneum Press, 1994.
- Naka, Atsuyuki. and Whitney, GERAL. The unbiased forward rate hypothesis re-examined. Journal of International Money and Finance 14(1995): 857-867.
- Nelson, Charles R. and Plosser, Charles I. Trends and random walks in macroeconomic time series. Journal of Monetary Economics 10(September 1982): 139-162.
- Pindyck, Robert S. and Rubinfeld, Daniel L. Econometric Models and Economic Forecasts. Singapore: McGraw-Hill, 1997.
- Rivera-Batiz, Franciso L. International Finance and Open Economy Macroeconomics. New York: Macmillan, 1994.
- Sephton, Peter S. and Larsen, Hansk. Tests of exchange market efficiency : fragile evidence from cointegration tests. Journal of International Money and Finance 10(1991): 561-570.
- Walter, Enders. Applied Econometric Time Series. USA: John Wiley & Sons, 1995.

ประวัติผู้เขียน

นาย ธเนศ กิตติชีวะเวช เกิดวันที่ 29 พฤษภาคม พ.ศ. 2514 ที่จังหวัด กรุงเทพฯ สำเร็จการศึกษาระดับปริญญาตรีวิทยาศาสตร์บัณฑิต สาขาเอก คณิตศาสตร์ สถาบันเทคโนโลยีพระจอมเกล้าธนบุรี ในปีการศึกษา 2536 และเข้าศึกษาต่อในหลักสูตรเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย ในปีการศึกษา 2540

