

## เอกสารอ้างอิง

- กรณีการ ลิปตพัลลภ. การเงินระหว่างประเทศ. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัย  
เกษตรศาสตร์, 2532.
- ชัยยุทธ์ ปัญญาสวัสดิ์สุทธิ. เจาะมาตรการแก้วิกฤตเศรษฐกิจ. กรุงเทพฯ: ร่วมด้วยช่วยกัน, 2543.
- ดาว ชุ่มตะขบ. “ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่ออัตราแลกเปลี่ยนและการพยากรณ์ค่าเงินบาท.” วารสารเศรษฐ  
ศาสตร์ มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์ 8, 1(มกราคม – มิถุนายน 2544): 51-68.
- เดลินงศ์ศักดิ์ นุชประหาร. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อการกำหนดอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่าง  
ประเทศ. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2542.
- ธนาคารกรุงเทพพาณิชย์การ. ประวัติเงินตราและอัตราแลกเปลี่ยนเงินไทย. กรุงเทพฯ: บพิชการ  
พิมพ์, 2512.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. การปฏิรูประบบการเงินระหว่างประเทศ. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์ชวน  
พิมพ์, 2516.
- \_\_\_\_\_. การจัดระบบการแลกเปลี่ยนเงินในระยะสงคราม. (หนังสืออนุสรณ์งานพระราชทาน  
เพลิงศพหม่อมหลวงเดช สนิทวงศ์ เมื่อวันที่ 17 ธันวาคม 2518). กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์  
ชวนพิมพ์, 2518.
- \_\_\_\_\_. ระบบการเงินยุโรป (European Monetary System). กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์ชวนพิมพ์,  
2522.
- \_\_\_\_\_. ทูกรักษาระดับอัตราแลกเปลี่ยนเงินตรา. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์ชวนพิมพ์, 2528.
- \_\_\_\_\_. สถิติเศรษฐกิจและการเงิน. กรุงเทพฯ: สายฐานข้อมูล ธนาคารแห่งประเทศไทย, 2547.
- นิรันดร์ วิศวกร. “แบบจำลองการเคลื่อนไหวของอัตราแลกเปลี่ยน.” วารสารเศรษฐศาสตร์ธรรม  
ศาสตร์ 14, 1(มีนาคม 2539): 23-47.
- รังสรรค์ ธนะพรพันธุ์. เศรษฐกิจไทยหลังวิกฤตการณ์ปี 2540. กรุงเทพฯ: โครงการจัดพิมพ์คบไฟ,  
2545.
- รังสรรค์ หทัยเสรี. “Cointegration and Error Correction Approach: ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์  
ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐศาสตร์มหภาค.” วารสารเศรษฐศาสตร์ธรรมศาสตร์ 13, 3  
(กันยายน 2538): 20-55.

- วิจักขณ์ ศิริเสร์. การบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนภายใต้ระบบลอยตัว. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์พิมพ์ดี, 2541.
- สมหญิง ภูษาธร. นโยบายอัตราแลกเปลี่ยนของไทย พ.ศ. 2521-2541. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2524.
- สีหราช อัครประเสริฐ. ค่าเงินบาทที่เหมาะสมและการกำหนดอัตราแลกเปลี่ยนตามความเป็นจริงของประเทศไทย. วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์, 2537.
- อำนาจ ศรีสุขสันต์. ดัชนีค่าเงินบาทและปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อการกำหนดอัตราแลกเปลี่ยนเหมาะสมของไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2531.
- Bilson, J.F.O. "Rational Expectations and the Exchange Rate." In Frenkel, J.A. and Harry, G.J. **The Economics of Exchange Rates**. New York: Addison-Wesley, 1978.
- \_\_\_\_\_. "The Current Experience with Floating Exchange Rates: An Appraisal of the Monetary Approach." **The American Economic Review** 68, 2(May1978): 392-397.
- Boothe, P. and Glassman, D. "Comparing Exchange Rate Forecasting Model." **International Journal of Forecasting** 3(June 1987): 65-79.
- Box, G.E.P. and Jenkins, G.M. **Time Series Analysis, Forecasting and Control**. Sanfrancisco: Holden Day, 1970.
- Boyko, Nataliya. **The Monetary Model of Exchange Rate Determination: The Case of Ukraine**. Master's thesis. Arts in Economics. The National University of Kiev-Mahyla Academy, 2002. แหล่งที่มา <http://www.eerc.kiev.ua/research/matheses/2002/pdf/Boyko.pdf> 23 กุมภาพันธ์ 2547.
- Carbaugh, Robert J. **International Economics**. 8<sup>th</sup> ed. United States: South-Western Thomson Learning, 2002.
- Charemza, W. and Deadman, D. **New Directions in Econometric Practice**. Cambridge: University Press, 1992.
- Diamandis, P.F.; Georgoutsos, D.A. and Kouretas, G.P. "Cointegration Tests of the Monetary Exchange Rate Model: the Canadian-U.S. Dollar, 1970-1994." **International Economic Journal** 10, 4(Winter 1996): 83-97.

- Dickey, D.A. and Fuller, W.A. "Distributions of the estimators for Autoregressive Time Series with a Unit Root" **Journal of American Statistical Association** 74 (March 1979): 427-431.
- Dornbusch, R. "Expectations and Exchange Rate Dynamics." **The Journal of Political Economy** 84, 6(December 1976): 1161-1176.
- Driskill, R.A. and Sheffrin, S.M. "On the Mark: Comment." **The American Economic Review** 71, 3(June 1981): 1068-1074
- Enders, Walter. **Applied Econometric Time Series**. New York: John Wiley & Sons, 1995.
- Engle, R. F. and Granger, C.W.J. "Cointegration and Error Correction: Representation, Estimation and Testing" **Econometrica** 55, 2 (March 1987): 251-276.
- Frankel, J.A. "On the Mark: A Theory of Floating Exchange Rates based on Real Interest Differentials." **The American Economic Review** 69, 4(May 1979): 610-622.
- Frankel, J.A. "The Mystery of the Multiplying Marks: A Modification of the Monetary Model." **The Review of Economics and Statistics** 64, 3(August 1982): 515-519.
- Frenke, G.; Olsen, R. and Pohlmeier, W. 2002. "Overview of Forecasting Models." In **Seminar on High Frequency Finance**. Konstanz University. แหล่งที่มา [www.olsen.ch/center/papers/Amann %20exchange-rates.pdf](http://www.olsen.ch/center/papers/Amann%20exchange-rates.pdf). 15 พฤษภาคม 2547.
- Frenkel, J.A. "A Monetary Approach to the Exchange Rate: Doctrinal Aspects and Empirical Evidence." **Scandinavian Journal of Economics** 78(March 1976): 200-234.
- Gujarati, D.N. **Basic Econometrics**. 3<sup>rd</sup> ed. Singapore: McGraw - Hill, 1995.
- Haynes, S.E. and Stone, J.A. "On the Mark: Comment." **The American Economic Review** 71, 3(June 1981): 1060-1067.
- Hodrick, J.R. "An Empirical Analysis of the Monetary Approach to the Determination of the Exchange Rate." In Frenkel, J.A. and Harry, G. Johnson. **The Economics of Exchange Rates**. New York: Addison-Wesley, 1978.
- International Monetary Fund. **International Financial Statistics**. (CD-ROM). Washington, DC: IMF, 2004.
- Johansen, S. and Juselius, K. "Maximum Likelihood Estimation and Inference on Cointegration: With Applications to the Demand for Money." **Oxford Bulletin of Economics and Statistics** 52(May 1990): 169-210.

- Johnston, J. and Dinardo, J. **Econometric Methods**. 4<sup>th</sup> ed. New York: McGraw – Hill, 1997.
- Krugman, Paul R. and Obstfeld, M. **International Economics: Theory and Policy**. 4<sup>th</sup> ed. New York: Addison – Wesley, 1997.
- MacDonald, R. and Taylor, M.P. “The Monetary Model of the Exchange Rate: Long-run Relationships, Short-run Dynamics and How to Beat a Random Walk.” **Journal of International Money and Finance** 13, 3(June1994): 276-290.
- MacKinnon, J.G. “Critical Value for Cointegration Tests” in **Long-run Economic Relationships: Reading in Cointegration**. Edited by R.F. Engle and C. W. Granger, Oxford, **Oxford University Press**, 1991: pp. 267-276.
- Rapach, D.E. and Wohar, M.E. “Testing the Monetary Model of Exchange Rate Determination: New Evidence from a Century of Data.” **Journal of International Economics**. 58, 2 (December 2002): 359-385.
- Rose, Peter S. **Money and Capital Markets: Financial Institutions and Instruments in a Global Marketplace**. 8<sup>th</sup> ed. New York: McGraw – Hill, 2003.
- Sarantis, N. “The Monetary Exchange Rate Model in the Long-Run: An Empirical Investigation.” **Weltwirtschaftliches Archiv Review of World Economics** 130, 4(August 1994): 698-711.
- Smith, P.N. and Wickens, M.R. “An Empirical Investigation into the Causes of Failure of the Monetary Model of the Exchange Rate.” **Journal of Applied Econometrics** 1, 2 (April 1986): 143-162.
- Wilson, C.A. “Anticipated Shocks and Exchange Rate Dynamics.” **Journal of Political Economy** 87, 3(June 1979): 639-647.