

บรรณานุกรม

หนังสือ

- กัลยา วานิชย์บัญชา. **หลักสถิติ**. คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2539.
- จรัสพล ธนพิทักษกุล. **เล่น "เงิน" ให้รวยอย่างเหนือชั้น**. กรุงเทพฯ: สำนักพิมพ์สุขภาพใจ, 2537.
- จรินทร์ เทศวานิช. **เงิน ตลาดการเงินและสถาบันการเงิน**. กรุงเทพฯ: บริษัทซีเอ็ดดูเคชั่นจำกัด, 2535
- จารุมา อัฐกุล. **สถิติเชิงคณิตศาสตร์**. คณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2541.
- เจน ประสิทธิ์ล้ำค่า. **พฤติกรรมกรรมการเคลื่อนไหวของราคาหลักทรัพย์**. วิทยานิพนธ์มหาบัณฑิต คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2326.
- ชัชวาล เรื่องประพันธ์. **สถิติพื้นฐาน**. ภาควิชาสถิติ คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยขอนแก่น, 2539
- ชัยชาญ วิบูลย์ศิลป์. **เจาะวิกฤตสถาบันการเงินไทย**. กรุงเทพฯ: ห้างหุ้นส่วนจำกัดเอราวัณการพิมพ์, 2541
- ถนอมศรี ฟองอรุณรุ่ง. **การทดสอบระดับความผันผวนของหลักทรัพย์**. วิทยานิพนธ์มหาบัณฑิต คณะ เศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2537.
- เกียรติชัย อารยะรัตน์. **การวิเคราะห์การเปลี่ยนแปลงทางด้านโครงสร้างของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยเชิงเศรษฐศาสตร์ ตั้งแต่ พ.ศ. 2518-2536**. วิทยานิพนธ์มหาบัณฑิต บัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2538.
- เพชรี ชุมทรัพย์. **หลักการลงทุน**. สำนักพิมพ์ธรรมศาสตร์, 2539.
- วิจักษณ์ ศิริแสงร์. **การบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนภายใต้ระบบลอยตัว**. กรุงเทพฯ :ไอไอที อินเทอร์เน็ต รีซอสเซส จำกัด ,2540
- สนอง แซ่มรัตน์. **ประสิทธิภาพตลาดปริวรรตเงินตราต่างประเทศของไทย**. วิทยานิพนธ์มหาบัณฑิต คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2533.
- สมจิต วัฒนายากุล. **สถิติวิเคราะห์เบื้องต้น**. คณะวิทยาศาสตร์และเทคโนโลยี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2532.
- สิงหะ นิกรพันธุ์. **มารู้จัก การบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน**. กรุงเทพฯ: บริษัทพิมพ์ดี จำกัด, 2538.

สุรพล ดุรงค์วัฒนากุล. การวิเคราะห์เชิงสถิติ : การวิเคราะห์ความแปรปรวน. ภาควิชาสถิติ คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

อำนาจ ศรีสุขสันต์. ดัชนีค่าเงินบาทและปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อการกำหนดอัตราแลกเปลี่ยนในประเทศไทย.วิทยานิพนธ์มหาบัณฑิต คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2531.

วารสาร

ณรงค์ ศรีสุอัน. "ตลาดการเงินต่างประเทศ." **วารสารธนาคาร.** (มิถุนายน 2526) : 20-26.

"ปัจจัยที่เป็นตัวกำหนดการเคลื่อนไหวของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ." **สรุปข่าวธุรกิจ.** 12(1-15 กรกฎาคม 2524) : 25-26.

รังสรรค์ หทัยเสรี. "อัตราแลกเปลี่ยนระบบลอยตัว: ก้าวอย่างที่สำคัญของระบบการเงินไทยและนัยต่อการบริหารธุรกิจ" **วารสารบริหารธุรกิจ.** 75(กรกฎาคม-กันยายน):1-10

Book

Greene, William h. *Econometric Analysis.* New Jersey : Prentice-Hall, Inc ., 1993.

Gujarati, Damodar N. *Basic Econometrics.* Singapore: McGraw-Hill, inc, 1995.

Kim, Yoon Chul, Ph.D. *Exchange Rate Volatility, Uncertainty and the Stock Market.* State University of New York at Albany, 1990.

Articles

Aczel, Amir D. and Josephy, Norman H. "The Chaotic Behavior of Foreign Exchange Rate." **The American Economist,** 35,2(Fall 1991) : 16-24.

Baldauf, Brad. And Santoni, G.J. "Stock Price Volatility : Some Evidence form an ARCH Model." **The Journal of Future Markets,** 11,2(1991) : 191-200.

Bollerslev, Tim. "A Conditionally Heteroskedastic Time Series Model for Speculative Prices and Rates of Return." **The Review of Economics and Statistics,** (1987) : 542-547.

_____. "Bid-ask spreads and volatility in the foreign exchange market." **Journal of international Economics,** 36(1994) : 355-372.

- _____. "Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity." *Journal of econometrics*, 31(1986) : 307-327.
- Copeland, Laurence S. "Estimating Daily Seasonality in Foreign Exchange market." *Journal of Forecasting*, 13(June 1994) : 519-528.
- Engle, Robert F. "Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimates of the Variance of United Kingdom Inflation." *Econometrica*, 50,4(July 1984) : 987-1007.
- Flood, Robert P. and Hobbieck, Robert J. "Exchange Rate and Price Dynamics with Asymmetric Information." *International Economic Review*, 25,3(October 1984) : 513-526.
- Frenkel, Jacob A. "Flexible Exchange Rates, Prices, and the Role of 'News' : Lessons from the 1970s." *Journal of Political Economy*, 89,4(1981):665-705.
- Froot, Kenneth A. and Thaler, Richard H. "Anomalies Foreign Exchange." *Journal of Economic Perspectives*, 4,3(Summer 1990) : 179-192.
- Giovannini, Alberto. and Jorion, Philippe. "The Time Variation of Risk and Return in the Foreign Exchange and Stock Markets." *The Journal of Finance*, 24,2(June 1989) : 307-325.
- Hodrick, Robert J. "Risk, Uncertainty, and Exchange Rate." *Journal of Monetary Economics*, 23(1989) : 433-459.
- Koedijk, Kees G. and Schotman, Peter. "How to Beat the Random Walk An Empirical Model of Real Exchange Rates" *Journal of International Economics*, 29(1990): 311-332.
- Lamoureux, Christopher G. and Lastrapes, William D. "Heteroskedasticity in Stock Return Data : Volume versus GARCH Effects." *The Journal of Finances*, 16,1 (March 1990) : 221-229.
- Lastrapes, William D. "Exchange Rate Volatility and U.S. Monetary Policy : An ARCH Application." *Journal of Money, Credit, and Banking*, 21,1(February 1989) : 66-77.
- Nachane, D. M. "Modelling Exchange Rate Dynamics." *Journal of Forecasting*, 12(1993) : 379-394.
- Pearce, Douglas K. and Roley, V. Vance. "The Reaction of Stock Price to Unanticipated Change in Money : A Note." *The Journal of Finance*, 38,4(September 1983):1323-1333.