

參考文獻

中文部分

許哲瑋〔2003〕，「資料挖掘與統計方法應用於資料庫行銷之實證研究—以美妝保養品」，國立台北大學企業管理學系碩士論文。

盧信銘〔2002〕，「Random Walk Hypothesis in Exchange Rate Reconsidered」，國立台灣大學經濟學研究所碩士論文。

廖元宏〔2002〕，「以 STAR 模型研究新台幣實質有效匯率」，國立中山大學財務管理學系研究所碩士論文。

鄭家欣〔2002〕，「模糊概念之萃取與診斷在適性教學應用之研究」，銘傳大學資訊管理研究所碩士論文。

楊銘峰〔2001〕，「新台幣對美元匯率決定之研究—時間數列方法應用」，銘傳大學經濟學研究所碩士論文。

何慧慧〔2001〕，「歐元匯率預測模型之提出」，國立台北大學企業管理學系碩士論文。

朱修明〔2001〕，「模糊模型規則庫自動建立之演算法」，國立台灣科技大學電機工程系碩士論文。

施向陽〔2001〕，「匯率變動預測模式之研究」，大葉大學事業經營研究所碩士班碩士論文。

陳惠美〔2001〕，「匯率模型預測績效之探討」，淡江大學財務金融學系碩士論文。

黃泰孚〔2000〕，「以移動窗及片段線性回歸的分析架構建立 Takagi-Sugeno 模糊系統模型」，國立台灣科技大學電機工程系碩士論文。

葉俊佃〔2000〕，「匯率波動與非線性系統之關聯性研究」，國立台灣大學國際企業研究所碩士論文。

葉松炫〔2000〕，「運用類神經網路預測匯率」，國立中山大學財務管理研究所碩士論文。

陸君芬〔1998〕，「有關匯率隨機漫步性質之再議」，國立政治大學經濟學研究所碩士論文。

葉時魁〔1997〕，「新台幣兌美元匯率變動率之渾沌性質延性質研究」，淡江大學國際企業學研究所碩士論文。

Paul Ormerod〔2000〕，「蝴蝶效應經濟學——一項關於社會與經濟行為的新理論」，聯經出版社。

英文部分

Brooks, C., (1996) “Testing for Nonlinearity in Daily Sterling Exchange Rates”, *Applied Financial Economics*, Vol. 6, pp. 307-317.

De Grauwe, P., Dewachter, H., Embrechts, M., (1993) “Exchange Rate Theory: Chaotic Models of Foreign Exchange Markets”, Blackwell.

Diebold, F.X., & Nason, J., (1990) “Nonparametric Exchange Rate Prediction?”, *Journal of International Economics*, Vol. 28, pp. 315-332.

Diebold, F.X., & Mariano, R. S., (1995) “Comparing predictive accuracy”, *Journal of Business & Economic Statistics*, 13(3), pp. 253-263.

Engel, C., & Hamilton, J., (1990) “Long Swings in the Dollar: Are They in the Data and Do Markets Know It?”, *American Economic Review*, Vol. 80, pp. 689-713.

Engel, C., (1994) “Can the Markov Switching Model Forecast Exchange Rates”, *Journal of International Economics*, Vol. 36, pp. 151-165.

Frenkel, J. A., (1976) “A Monetary Approach to the Exchange Rates:

Doctrinal Aspects and Empirical Evidence” , Scandinavian Journal of Economics, Vol. 78, pp. 200–224.

Granger, C.W.J., & Terävirta, T., (1993) “Modelling Nonlinear Economic Relationships” , Oxford University Press.

Hamilton, J., (1989) “A New Approach to the Economic Analysis of Nonstationary Time Series and the Business Cycle” , Econometrica, Vol. 57, pp. 357–384.

Leybourne, S. J., Mizen, P. (1997) “Disinflation and Central Bank Independence in Australia, Canada and New Zealand: Evidence from Smooth Transition Analysis” Discussion Paper, No. 97/6, Department of Economics, University of Nottingham.

Meese, R. A., & Rogoff, K., (1983) “Empirical Exchange Rate Models of the Seventies” , Journal of International Economics, Vol. 14, pp. 3–24.

Michael, P., Nobay, A. R. & Peel, D. A., (1997) “Transaction Costs and Nonlinear Adjustment in Real Exchange Rates: an Empirical Investigation” Journal of Political Economy, Vol. 105, pp. 862–879.

Peter, E. E., (1994) “Fractal Market Analysis: Applying Chaos Theory to Investment and Economics” , John Wiley and Sons.

Sarantis, N., (1999) “Modeling Nonlinearities in Real Effective Exchange Rates” Journal of International Money and Finance, Vol. 18, pp. 27–45.

Takagi, T., & Sugeno, M., (1985) “Fuzzy Identification of Systems and its applications to modelong and control” , IEEE Trans. Syst. Man, Cybern. Vol. SMC-15, pp. 116–132.

Terävirta, T. & Anderson, H. M., (1992) “Characterizing Nonlinearities in Business Cycles Using Smooth Transition Autoregressive Models” Journal of Applied Econometrics, Vol. 7, pp. S-119–S136.

Terävirta, T., (1994) “Specification, Estimation, and Evaluation of Smooth Transition Autoregressive Models”, Journal of the American Statistical Association, Vol. 89, pp. 208–218.

Zadeh, L. A., (1965) “Fuzzy set” , Inform. Control, Vol. 8, pp. 335–353.