เอกสารอ้างอิง

กัญญาพร จิตต์จำนงค์. 2547. **การศึกษาปัจจัยที่มีผลกระทบต่อรายได้จากการท่องเที่ยวของประเทศไทย : กรณีศึกษารายได้จากนักท่องเที่ยวชาวญี่ปุ่น เยอรมนี อังกฤษ สหรัฐอเมริกา และจีน.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์ธุรกิจ มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยหอการค้าไทย.

"บทวิเคราะห์อุตสาหกรรมท่องเที่ยวปี 2552." 2551. **ประชาทรรศน์.** [ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา: http://www.prachatai.com/05web/th/home/page2.php. (9 ธันวาคม 2551).

"แบงก์ชาติ เผยบิ๊มหาดใหญ่-รัฐประหาร ตัวการทำเศรษฐกิจใต้ชะงัก-การลงทุนอืด " 2552. **ผู้จัดการรายวัน.** [ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา : http://www.gotomanager.com /news/printnews.aspx?id=53502. (10 กุมภาพันธ์ 2552).

"แบงก์ชาติรับไฟใต้-ไข้หวัดนก ทำเศรษฐกิจใต้ทรุด. " 2547. **กรุงเทพธุรกิจ.** [ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา : http://news.cedis.or.th/detail.php?id=1815&lang=en&group_id=1. (10 กุมภาพันธ์ 2552).

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์**. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ อ้างถึงใน สธนพล วิเชียรรัตนพันธ์. **การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการ์ชเอ็ม : กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์.** การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ศูนย์วิจัยกสิกรไทย. 2551 " กระแสทัวร์นอกมาแรง : กระทบรายได้สุทธิด้านการท่องเที่ยวโตช้าลง" **มองเศรษฐกิจ** ฉบับที่ 2142. [ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา: http://www.kasikornresearch.com/portal/site/KResearch/rsh_d/?cid=10&id=14665 (19 ธันวาคม 2551).

อภิสิทธิ์ สรรพดิลก. 2548. **การส่งผ่านความไม่แน่นอนของปัจจัยที่มีผลในตลาดซื้อขายไฟฟ้าจากประสบการณ์ของต่างประเทศโดยใช้วิธีแบบจำลอง MULTIVARIATE GARCH.** วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

Alexander, C.O. 2001. "Orthogonal GARCH." In Alexander, C.O. (ed.). **Mastering Risk** 2 : 21–38.

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

Bollerslev, T. 1986. "Generalized autoregressive conditional heteroskedasticity." **Journal of Econometrics** 31: 307-327.

Bollerslev, T. 1990. "Modelling the coherence in short-run nominal exchange rate: A multivariate generalized ARCH approach." **Review of Economics and Statistics** 72 : 498-505

Bollerslev, T and Wooldridge, J.M. 1992. "Quasimaximum likelihood estimation and inference in dynamic models with time-varying covariances." **Econometric Reviews** 11 : 143-173.

Bollerslev, T; Engle ,R and Wooldridge ,J. 1988. "A capital asset pricing model with time-varying covariances." **Journal of Political Economy** 96 (1) : 116-131.

Engle, R.F. 1982. "Autoregressive conditional heteroscedasticity with estimates of the variance of United Kingdom inflation**."** **Econometrica** 50 : 987-1007.

Engle, R.F. 2002. "Dynamic conditional correlation: anew simple class of multivariate GARCH models." **Journal of Business and Economic Statistics** 20 :339-350.

Engle, R.F. and Kroner, K. 1995. "Multivariate simultaneous generalised ARCH." **Econometric Theory** 11 : 122-150.

Hoti, S.; Chan, F. and McAleer, M. 2002. "Structure and asymptotic theory for multivariate asymmetric volatility: Empirical evidence for country risk ratings**."** paper presented to **the Australasian Meeting of the Econometric Society**, July, Brisbane, Australia.

Hoti, S.; McAleer, M. and Pauwels, L.L. 2008. "Multivariate volatility in environmental finance." **Mathematics and Computers in Simulation** p. 2225-2231.

Ling, S. and McAleer,M. 2003. "Asymptotic theory for a vector ARMA-GARCH model." **Econometric Theory** 19: 278-308.

Nelson, D.B. 1991. "Conditional heteroscedasticity in asset returns: A new approach." **Econometrica** 59: 347-370.

Tse, Y.K. & Tsui, K.C. 2002. "A multivariate generalized autoregressive conditional heteroscedasticity model with time-varying correlations." **Journal of Business and Economic Statistics** 20: 351-362.

Wong, H. and Li,W.K. 1997. "On a multivariate conditional heteroscedasticity model." **Biometrika** 4: 111-123

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved