

เอกสารอ้างอิง

- กัญญาพร จิตต์จำนงค์. 2547. การศึกษาปัจจัยที่มีผลกระทบต่อรายได้จากการท่องเที่ยวของประเทศไทย : กรณีศึกษารายได้จากนักท่องเที่ยวชาวญี่ปุ่น เยอรมนี อังกฤษ สหรัฐอเมริกา และจีน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยหอการค้าไทย.
- จิตติ ตันเสนีย์. 2549. การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์ราคาหลักทรัพย์ ระหว่างแบบจำลองนิเวออลเน็ตเวิร์ค กับแบบจำลองอาร์มีมาและอีการ์ชเอ็ม. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- “บทวิเคราะห์อุตสาหกรรมท่องเที่ยวปี 2552.” 2551. ประชาทรรศน์. [ระบบออนไลน์] แหล่งที่มา: <http://www.prachatai.com/05web/th/home/page2.php>. (9 ธันวาคม 2551).
- “เบงกัชชาติรับไฟใต้-ใช้หัวคนก ทำเศรษฐกิจได้ทรุด.” 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.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2542. “พฤติกรรม การส่งผ่านราคาทุ้มทุ่นค้าระหว่างตลาดค้าส่งโตเกียวกับตลาดผู้ค้าปลีกในประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 33,3 (กันยายน-ธันวาคม): 16-51. อ้างถึงใน สธนพล วิเชียรรัตน์ พันธุ์. 2547. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม: กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สธนพล วิเชียรรัตน์ พันธุ์. 2547. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม: กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อภิสิทธิ์ สรรพดิกล. 2548. การส่งผ่านความไม่แน่นอนของปัจจัยที่มีผลในตลาดซื้อขาย ไฟฟ้า จากประสบการณ์ของต่างประเทศโดยใช้วิธีแบบจำลอง MULTIVARIATE GARCH. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- Alexander, C.O. 2001. “Orthogonal GARCH.” Alexander, C.O. (ed.), *Mastering Risk 2* : 21–38.

Asai, M. and McAleer, M. 2005, “Dynamic asymmetric leverage in stochastic volatility model”
Econometric Reviews No.24.

Baillie, R. T. 1996. “Long memory processes and fractional integration in econometrics”
Journal of Econometrics 73: 5-59.

Bollerslev, Tim. 1986. “Generalized autoregressive condition heteroscedasticity.” **Journal of Econometrics** 31: 307-327. อ้างถึงใน สรณพล วิเชียรรัตน์พันธ์. 2547. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม: กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

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 Mikkelsen, H. O. 1996. “Modeling and pricing long memory in stock market volatility” **Journal of Econometrics** 73, 151-184.

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.

Dickey, D.A., and Fuller, W.A.. 1981. “Likelihood ratio statistic for autoregressive time series with a unit root.” **Econometrica** 49. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

Edward, Sebastian. 1998. “Interest rate volatility, contagion and convergence : an empirical investigation of the cases of Argentina, Chile and Mexico.” **Journal of Applied Economics** 1 (November) : 55-86

Enders, Walter. 1995. **Applied econometric time series**. New York: John Wiley & Sons. อ้างถึงใน สรณพล วิเชียรรัตน์พันธ์. 2547. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม: กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

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

- Engle, R.F.; Lilien, D and Robins, R.P. 1987. "Estimating Time Varying Risk Premia in the Term Structure: The ARCH-M model." **Econometrica** 55 : 391-407. อ้างถึงใน สธนพล วิเชียรรัตน์พันธ์. 2547. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการชเอ็ม: กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- 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.
- Said, S. and Dickey, D. 1984. "Testing for unit roots in autoregressive-moving average models with unknown order." **Biometrics** 71. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Tse, Y.K. and 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.