

## เอกสารอ้างอิง

- ชนานุช จันทรา. 2552. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับอัตราผลตอบแทนของดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ณิษา พุศรีนวล. 2552. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราเงินเฟ้อและอัตราดอกเบี้ยของประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตติ: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิตติศักดิ์ กิตติศักดิ์ธาดากุล. 2552. ผลกระทบความผันผวนของเงินเฟ้อและอัตราแลกเปลี่ยนของจำนวนนักท่องเที่ยวต่างชาติที่เข้ามาเที่ยวในประเทศไทย โดยวิธี มัลทิวาริเอทการซ์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ธีระ ภูตระกูล. 2552. 5 ช่องทางลงทุนสุดปัง ยามเศรษฐกิจโลกป่วย. แหล่งที่มา: [http://www.bangkokbiznews.com/home/news/finance/personal/2009/01/05/news\\_3911.php](http://www.bangkokbiznews.com/home/news/finance/personal/2009/01/05/news_3911.php) (5 มกราคม 2552)
- นนทลี ศรีสว่าง. 2552. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราเงินเฟ้อและการว่างงานของประเทศไทย โดยวิธีไบวาริเอทการซ์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ฝ่ายกำกับการขายหลักทรัพย์ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การคำนวณดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th/th/products/index/files/2008-IndexMethodology-TH.pdf> (1 กรกฎาคม 2553)
- ฝ่ายสื่อสิ่งพิมพ์ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2547. ก้าวแรกสู่การลงทุนในตลาดหลักทรัพย์. พิมพ์ครั้งที่ 10. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- พัชฌันยา พังนิตนกรณ์. 2552. ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยน และความผันผวนของการนำเข้าน้ำมันดิบของประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

วิกิพีเดีย สารานุกรมเสรี. ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. แหล่งที่มา:

<http://th.wikipedia.org/wiki/ดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย>

วิน พรหมแพทย์. 2552. “สินค้าโภคภัณฑ์คืออะไร.” ASTVผู้จัดการออนไลน์ (22 พฤษภาคม)

เศรษฐวุฒิ สุทธิวาหนฤวุฒิ. ผลตอบแทนการลงทุนในสินทรัพย์ประเภทต่างๆของไทย. SET Note ฉบับที่ 5 ปี 2549. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์. 2552. การลงทุนในสินค้าโภคภัณฑ์ทำได้อย่างไรบ้าง. แหล่งที่มา: [http://www.sec.or.th/webedu/content.html?menu\\_id=432](http://www.sec.or.th/webedu/content.html?menu_id=432) (23 มิถุนายน 2553)

Bollerslev, T. 1990. **Modelling the coherence in short-run nominal exchange rates:**

**A multivariate generalized ARCH approach.** Review of Economics and Statistics, 72, 498-505.

Chaiwat Nimanussornkul, Kunsuda Nimanussornkul, Pimonpun Boonyasana and Thanes

Sriwichailamphan. 2009. **Volatility and Volatility Spillovers in Crude Oil and**

**Precious Metals Markets.** ที่มา: [http://list.academic-journal.org/submissions/isfa2009\\_submission\\_96.pdf](http://list.academic-journal.org/submissions/isfa2009_submission_96.pdf)

Damodar N.Gujarati and Dawn C. Porter. 2009. **Basic Econometrics**, fifth edition, McGraw-Hill.

Ender, Walter. 2004. **Applied Econometric Time Series.** Second edition. New York: John Wiley and sons.

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

Glosten, L.R., Jagannathan, R., and Runkle, D.E. 1993. **On the relation between the expected value and volatility of the nominal excess return on stocks.** Journal of Finance, 48, 1779-1801.

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

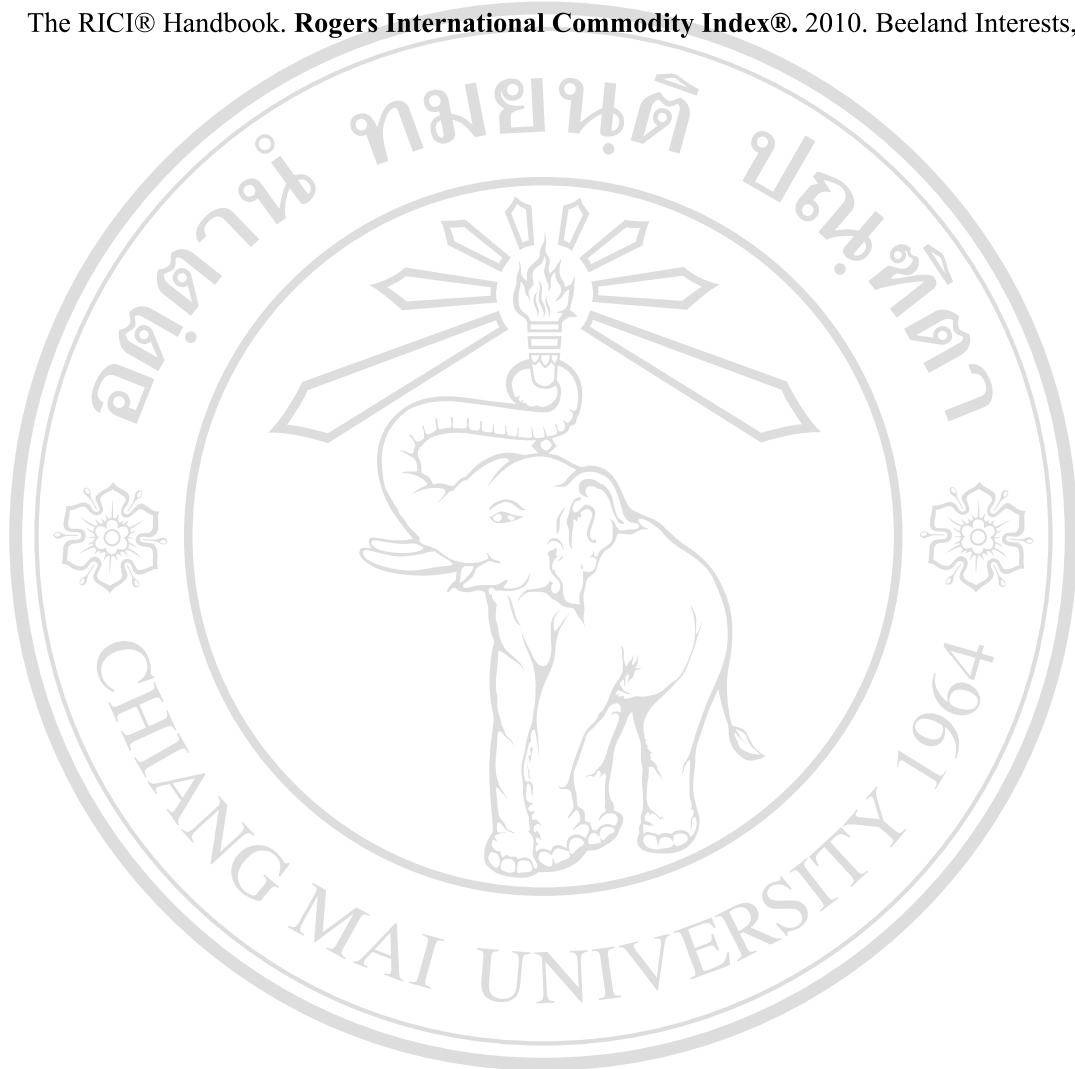
McAleer, M., Hoti, S. and Chan, F. 2009. **Structure and asymptotic theory for multivariate asymmetric conditional volatility.** Econometric Reviews, 28, 422-440.

Wikipedia the free encyclopedia. **Rogers International Commodity Index.** แหล่งที่มา:

[http://en.wikipedia.org/wiki/Rogers\\_International\\_Commodity\\_Index](http://en.wikipedia.org/wiki/Rogers_International_Commodity_Index)(25 มิถุนายน 2553)

Reuter. 2007. Reuters Kobra TM Version 3.5.1. Available: Finance And Investment Center  
,Chiang Mai University (15 พฤษภาคม 2010).

The RICI® Handbook. **Rogers International Commodity Index®**. 2010. Beeland Interests, Inc.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่  
Copyright© by Chiang Mai University  
All rights reserved