

เอกสารอ้างอิง

- กมลวรรณ คำแก้ว. 2548. แบบจำลองทางการเงินสำหรับการกำหนดอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของไทย. วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิตมหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- กัญสุดา นิมอนุสรณ์กุล และ เรืองชัย ต้นสุชาติ. 2553. “แบบจำลองอัตราผลตอบแทนและความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์ ตลาดพันธบัตรและตลาดอัตราแลกเปลี่ยนสำหรับประเทศไทยและประเทศญี่ปุ่น.”วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ (มกราคม – มิถุนายน): 70 - 90.
- จิตประพันธ์ ยืนสง่ามันคง. 2549. ศึกษาเรื่องการวิเคราะห์ปัจจัยที่มีผลกระทบต่อราคาทองคำในประเทศไทยและพยากรณ์ราคาทองคำด้วยแบบจำลองของบ็อกซ์และเจนกินส์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิตมหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ชนานุช จันทรา. 2552. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับอัตราผลตอบแทนของตลาดหลักทรัพย์ โดยวิธีไบวารรีเอทการซ์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิตมหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตี: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- _____ 2547. เศรษฐมิตี: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ อ้างถึงใน สธนพล วิเชียรรัตนพันธ์.
- _____ 2547. การวิเคราะห์ทางด้านเทคนิคด้วยแบบจำลองการซ์เอ็ม: กรณีศึกษาหลักทรัพย์ในกลุ่มอสังหาริมทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิตมหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2552. สถิติตลาดการเงิน (อัตราแลกเปลี่ยน). แหล่งที่มา: <http://www.bot.or.th/Thai/Statistics/FinancialMarkets/ExchangeRate/Pages/index.aspx> (8 พฤศจิกายน 2553)
- นฤมล เขาวิฑูรย์. 2542. ศึกษาความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนในตลาดแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศกับตลาดหลักทรัพย์. วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิตมหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- บริษัท ศูนย์วิจัยกสิกรไทย จำกัด. 2547. ทองคำ...อีกทางเลือกในการออมที่ไม่ควรมองข้าม (Online). แหล่งที่มา: www.kasikornreserach.com/index.wcgi. (11 พฤศจิกายน 2548)

บริษัท ศูนย์วิจัยกสิกรไทย จำกัด. 2553. **ทองคำทางเลือกในการลงทุน (Online).**

แหล่งที่มา: www.kasikornreserach.com/index.wcgi (28 ธันวาคม 2553)

พิจิตต์ อินดา. 2551. **การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราเงินเฟ้อกับอัตราการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของประเทศไทย ด้วยแบบจำลองไบวาเรจาร์ช. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.**

ภูมิฐาน รั้งคุณวุฒินันท์ และ จตุพร คงขาว. 2553. **“ปัจจัยที่มีผลต่อราคาทองคำแท่งในประเทศไทย.”**

วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ (กรกฎาคม – ธันวาคม): 24 - 40.

ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. 2531. **การวิเคราะห์หอนุกรมเวลา. มหาสารคาม : คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ.**

สมาคมค้าทองคำ. 2551. **ข้อมูลทั่วไปเกี่ยวกับทองคำ (Online).** แหล่งที่มา : www.goldtrader.or.th

(31 ตุลาคม 2551)

สมาคมผู้ค้าทองคำ. 2549. **ราคาทองคำ(Online).** แหล่งที่มา : www.goldpricethai.com

(11 ตุลาคม 2549)

อารยา กาญจนธราภกุล. 2551. **ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของปริมาณการส่งออกและความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนของประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.**

Aggarwal. R. 1981. **Exchange Rate and Stock Price Interactions in Emerging Financial Market: Evidence on India, Korea, Pakistan, and Philippines.** Applied Financial Economic 7: 25 - 35.

Bollerslev, T. 1986. **Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity.** Journal of Econometrics 31: 307 - 327

Choudhry, Taufiq. 2005. **Exchange rates volatility and the United States export: evidence from Canada and Japan.** Journal of the Japanese and International Economies 19: 51-71.

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

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

Frederic S. Mishkin. 2001. **The transmission mechanism and the role of asset prices in monetary policy.** NBER Working Paper, No 8617.

- Frederic S. Mishkin. 2003. **The Foreign Exchange Market, Theory of Rational Expectations and Efficient Capital Markets.** The Economics of Money, Banking, and Financial Markets 7: 151-177, 27: 691-714. อ้างถึงใน ชนานูช จันทรา. 2552. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับอัตราผลตอบแทนของตลาดหลักทรัพย์ โดยวิธีไบนารีเรอทการ์ช. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิตมหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- Hakim, A. and McAleer, M. 2008. "Forecasting conditional correlation in stock, bond and foreign exchange market." **Mathematics and Computers in Simulation.**
- Hakim, A. and McAleer, M. 2006. Modeling the Interaction Across International Stock, Bond and Foreign Exchange Markets. (Working Paper)
- Kruger, A. O. 1983. **Exchange Rate Determination.** Cambridge: Cambridge University Press
- Wikimedia Foundation. 2009. **Autoregressive conditional heteroscedasticity.**
[Online] Available: <http://en.wikipedia.org/wiki/GARCH>
- Nimanussornkul, C.; McAleer, M. and Sriboonchitta, S. 2009. **Modelling the stock and bond return and volatility in South-East Asia.** Paper conference in the second conference of the Thailand Econometric Society at Faculty of Economic: Chiang Mai University