

เอกสารอ้างอิง

กรมส่งเสริมการส่งออก. กระทรวงพาณิชย์. 2554. โครงสร้างสินค้าส่งออกของไทยปี 2535-2553.

แหล่งที่มา: <http://www2.ops3.moc.go.th> (24 เมษายน 2554)

กฤษฎา พงษ์ประพนธ์. 2553. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตรา

ผลตอบแทนจากดัชนีราคาสินค้าโภคภัณฑ์ของจิม โรเจอร์ และดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์
แห่งประเทศไทย โดยใช้แบบจำลองอาร์มาการซ์และอาร์มาเอการซ์. การค้นคว้าแบบอิสระ
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

เดือนใจ สมบูรณ์วิวัฒน์ และกฤษฎา จันทร์คล้าย. 2552. “โซ่อุปทานของการสร้างมูลค่าเพิ่ม
ยางพาราไทย.” ใน การประชุมสัมมนาวิชาการด้านการจัดการโลจิสติกส์และโซ่อุปทาน
ครั้งที่ 9. แหล่งที่มา: <http://bal.buu.ac.th/vcml2009/paper/S101.pdf> (24 เมษายน 2554)

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

นิติวัฒน์ ดวงงาม. 2552. แบบจำลองการส่งผ่านความผันผวนและความสัมพันธ์แบบมีเงื่อนไข
ระหว่างตลาดหุ้นและตลาดพันธบัตรของประเทศไทยและประเทศสิงคโปร์. การค้นคว้า
แบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

วรวัลย์ เอี่ยมมิ; ทิพวรรณ ปิ่นวนิชย์กุล และ ชูชัย ศรีคันสนีย์. 2550. ผลกระทบของ Fat-Tail ที่มี
ต่อการวัดผลดำเนินงาน และการจัดอันดับกองทุนรวมตราสารทุนในประเทศไทย.

แหล่งที่มา: http://www.stat.science.cmu.ac.th/.../CD.../29%20_101_P007.pdf

(6 มิถุนายน 2554)

วิญญูเดช นันไชยแก้ว. 2552. การวิเคราะห์ความผันผวนของดัชนีตลาดหลักทรัพย์ในกลุ่มประเทศ
G7. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ศูนย์วิจัยกสิกรไทย. 2554. แนวโน้มราคายางช่วงที่เหลือของปี 2554. แหล่งที่มา: <http://www.>

[corehoononline.com/images/stories/pdf/3070-p.doc](http://www.corehoononline.com/images/stories/pdf/3070-p.doc) (20 เมษายน 2554)

สถาบันวิจัยยาง. กรมวิชาการเกษตร. 2554. ปริมาณการส่งออกยางแยกตามประเภทของไทย.

แหล่งที่มา: http://www.rubberthai.com/statistic/stat_index.htm (24 เมษายน 2554)

สถาบันวิจัยยาง. กรมวิชาการเกษตร. 2553. **พื้นที่ปลูกยางพารา**. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์ชุมนุม
สหกรณ์การเกษตรแห่งประเทศไทย จำกัด.

สำนักงานส่งเสริมการค้าระหว่างประเทศ ณ กรุงจาการ์ตา. 2553. **การค้าและการลงทุนของ
อินโดนีเซีย: ภาวะเปรียบเทียบการค้ายางพารา**. แหล่งที่มา: [http://www.thaibizindonesia.com/
th/info-indonesia/trade-and-investment/trade-rules.php](http://www.thaibizindonesia.com/th/info-indonesia/trade-and-investment/trade-rules.php)

อังคณา สุวรรณกัญ. 2552. **ยางพาราสูงสุดสู่สามัญ**. แหล่งที่มา: [http://it.doa.go.th/pibai/pibai/
n11/v_11-jan/ceaksong.html](http://it.doa.go.th/pibai/pibai/n11/v_11-jan/ceaksong.html) (20 เมษายน 2554)

อัญญา ชันชวิทย์. 2547. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงจากการลงทุนในหลักทรัพย์**. กรุงเทพฯ: ตลาด
หลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

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

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

Candlestick Trading Forum. 2010. **Commodity Volatility**. Available: [http://www.candlestick
forum.com/PPF/Parameters/11_4613_/candlestick.asp](http://www.candlestickforum.com/PPF/Parameters/11_4613_/candlestick.asp) (June 20, 2011)

Chaiwan, A. 2009. **Long Memory and Forecasting Volatility in Financial Asset Returns**.
Thesis for the degree of Doctor of Philosophy (Economics), Chiang Mai University.

Chang, C.-L. et al. 2010. **Modelling conditional correlations in the volatility of Asian rubber
spot and futures returns**. Mathematics and Computers in Simulation. doi: 10.1016/
j.matcom.2010.07.004

Charemza, W. and Deadman, D. 1992. **New Directions in Econometric Practice**. London:
Edward Elgar Publishing. อ้างถึงใน อารีชัย วิบูลย์พงศ์. 2549. **เศรษฐมิติประยุกต์ สำหรับ
การตลาดเกษตร**. เชียงใหม่: ภาควิชาเศรษฐศาสตร์เกษตร คณะเกษตรศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

Christie, A. 1982. "The stochastic behavior of common stock variances: Value, leverage and
interest rate effects." **Journal of Financial Economics** 10: 407-432. อ้างถึงใน อัญญา
ชันชวิทย์. 2547. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงจากการลงทุนในหลักทรัพย์**. กรุงเทพฯ: ตลาด
หลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

- 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.
- Enders, Walter. 1995. *Applied Econometric Time Series*. New York: John Wiley&Sons. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์**. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Engle, R.F. 1982. "Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimates of Variance of United Kingdom Inflation." **Econometrica** 50: 987-1007.
- Engle, R.F. 2002. "Dynamic conditional correlation: A simple class of multivariate GARCH models." **Journal of Business and Economic Statistic** 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.
- Gujarati, Damodar N. 1995. **Basic Econometrics**. 3rd ed. New York: McGraw Hill. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์**. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Gujarati, Damodar N. 2009. **Basic Econometrics**. 5th ed. New York: McGraw Hill.
- International Rubber Study Group. 2010. **IRSG Rubber Statistical Bulletin** 64 (January-March). อ้างถึงใน สถาบันวิจัยยาง. กรมวิชาการเกษตร. 2553. **การผลิต การใช้ และการส่งออกยางของโลก**. กรุงเทพฯ: โรงพิมพ์ชุมนุมสหกรณ์การเกษตรแห่งประเทศไทย จำกัด.
- 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.
- Nimanussornkul, C. 2009. **Modelling stock and bond returns and volatility in South-East Asian Countries**. Thesis for the degree of Doctor of Philosophy (Economics), Chiang Mai University.
- National Bureau of Statistics of China. 2010. **National Accounts: Gross Domestic Product**. Available: <http://www.stats.gov.cn/tjsj/ndsjs/2010/indexeh.htm> (May 16, 2011)

Poon, S. and Granger C. 2003. "Forecasting volatility in financial markets: A review." **Journal of Economics Literature** XLI: 478-529.

Reserve Bank of India. 2010. **Macro-Economic Aggregates**. Available: <http://www.rbi.org.in/scripts/PublicationsView.aspx?id=12692> (May 16, 2011)

Said, S.E and Dickey D.A. 1984. "Testing for Unit Roots in Autoregressive-Moving Average of Unknown Order." **Biometrika** 71: 599-607.

United States Department of Agriculture. 2010. **USDA at Work in Indonesia**. Available: <http://www.fas.usda.gov/icd/TIM/Indonesia/Indonesia%20fact%20sheet%203-31-11.pdf> (April 16, 2011)