

เอกสารอ้างอิง

- กฤษฎา พงษ์ประพนธ์. 2553. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราผลตอบแทนจากดัชนีราคาสินค้าโภคภัณฑ์ของจิม โรเจอร์ และดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยใช้แบบจำลองอาร์มาการซ์ และอาร์มาเอการซ์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิราพร อนันต์มนตรีโชค. 2542. เงินทุนเคลื่อนย้ายสุทธิภาคเอกชนจากต่างประเทศ: ปัจจัยที่เป็นตัวกำหนดและผลกระทบ. วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตร์บัณฑิต(เศรษฐศาสตร์) มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์.
- ชาญณรงค์ ชัยพัฒน์. 2546. การศึกษาปัจจัยที่มีผลกระทบต่อ การเคลื่อนย้ายเงินในบัญชีทุนของประเทศไทย: รายงานการวิจัยฉบับสมบูรณ์. กรุงเทพฯ: สำนักงานกองทุนสนับสนุนการวิจัย.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2554. การแบ่งกลุ่มอุตสาหกรรมและหมวดย่อยของตลาดหลักทรัพย์. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th> (3 มีนาคม 2554)
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตี: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เบญจภรณ์ เศรษฐกนก. 2541. ปัจจัยที่มีผลกระทบต่อการลงทุนภาคเอกชน: การศึกษาเปรียบเทียบก่อนและหลังการใช้นโยบายเปิดเสรีทางการเงิน. วิทยานิพนธ์วิทยาศาสตร์บัณฑิต (เศรษฐศาสตร์) มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์
- ภูวดล อุ่่นอก. 2553. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคากลุ่มอุตสาหกรรมหลักในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- รพีพร ยุทธิวัฒน์. 2549. ปัจจัยกำหนดการเคลื่อนย้ายเงินลงทุนในหลักทรัพย์ไทยจากต่างประเทศ. สารนิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยรามคำแหง.
- รังสรรค์ หทัยเสรี และ ชัชวรุฒม์ มุสิกไชย. 2543. “เงินทุนเคลื่อนย้ายระหว่างประเทศและกลยุทธ์นโยบายการเงินหลังวิกฤตเศรษฐกิจเอเชีย: ประเด็นปัญหาและนัยต่อเครื่องมือบริหารจัดการเงินทุนของไทย.” การสัมมนาทางวิชาการประจำปี 2543 เรื่องนโยบายการเงินไทยในศตวรรษที่ 21. กรุงเทพฯ: ธนาคารแห่งประเทศไทย

- รัตนา สายคณิต. 2546. **หลักเศรษฐศาสตร์ II มหเศรษฐศาสตร์**. พิมพ์ครั้งที่ 3. กรุงเทพฯ: จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- สไบทิพย์ ไคร้อยงค์. 2553. **ผลกระทบของเงินทุนเคลื่อนย้ายระหว่างประเทศภาคเอกชนที่มีต่อตัวแปรทางการเงิน การบริโภคและการลงทุนภาคเอกชนของประเทศไทย**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อูยสาธา แพทย์เจริญ. 2552. **การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับดัชนีหมวดธุรกิจในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- อารีย์ วิบูลย์พงศ์. 2549. **เศรษฐมิติประยุกต์สำหรับการตลาดเกษตร**. เชียงใหม่: ภาควิชาเศรษฐศาสตร์เกษตร คณะเกษตรศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Bollerslev, T. 1986. "Generalised 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.
- Dickey, D.A., and W.A, Fuller. 1981. "Likelihood ratio statistic for autoregressive time series with a unit root." **Econometrica** 49. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์**. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Ender, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series**. Second edition. New York: John Wiley and sons.
- 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: anew 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. 2003. **Basic Econometrics**. 4th ed. Boston: McGraw Hill Irwin.
- International Rubber Study Group. 2010. **IRSG Rubber Statistical Bulletin** 64 (January-March).

Hecht, Yoel, Assaf Razin and Nitzan Gad Shinar. 2004. 'Interaction between Capital Inflows and Domestic Investment: Israel and Developing Economies.' **Israel Economics Review** 2,2:1-14.

Kim, Yoonbai. 2001. "Causes of Capital Flow in Developing Countries." **Journal of International Money and Finance** 19:235-253

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

Ling, S. and McAleer, M. 2002. "Stationarity and the existence of moments of a family of GARCH process." **Journal of Econometrics** 106: 109-117

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

Reuter.3000. **Reuters Kobra TM Version 3.5.1.** Available: Finance And Investment Center, Chiang Mai University (3 March 2011)