

เอกสารอ้างอิง

- กัญสุดา นิ่มอนุสรณ์กุล และ เริงชัย ต้นสุชาติ. (2553, มกราคม-มิถุนายน). แบบจำลองอัตราผลตอบแทนและความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์ ตลาดพันธบัตรและตลาดอัตราแลกเปลี่ยนสำหรับประเทศไทยและประเทศญี่ปุ่น. วารสารเศรษฐศาสตร์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่. 70-90.
- จิรัตน์ สังข์แก้ว. (2547). การลงทุน. กรุงเทพมหานคร : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. อีทีเอฟ. [ระบบออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : http://www.set.or.th/th/products/etf/etf_p1.html. (วันที่ค้นข้อมูล : 28 พฤษภาคม 2555).
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. Gold ETF. [ระบบออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : http://www.set.or.th/th/products/etf/files/Gold_ETF.pdf. (วันที่ค้นข้อมูล : 28 พฤษภาคม 2555)
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. (2547). เศรษฐมิตติ: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่ : คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- นิติวัฒน์ ดวงงาม. (2552). แบบจำลองการส่งผ่านความผันผวนและความสัมพันธ์แบบมีเงื่อนไขระหว่างตลาดหุ้นและตลาดพันธบัตรของประเทศไทยและประเทศสิงคโปร์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- บริษัท เว็ลธ์ แมเนจเม้นท์ ซิสเต็ม จำกัด. ผลการดำเนินงานของกองทุน. [ระบบออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก : <http://www.wealthmagik.com/FundInfo/FundHouseList.aspx>. (วันที่ค้นข้อมูล : 22 มิถุนายน 2555)
- ภวิษฐ์พร วงศ์ศักดิ์. (2549). การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของกองทุนรวมที่ลงทุนในต่างประเทศ. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิตมหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วรรณญา นวะมะรัตน์. (2550). การศึกษาการลงทุนในกองทุนรวม. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วิชญ์เดช นันไชยแก้ว. (2552). การวิเคราะห์ความผันผวนของดัชนีตลาดหลักทรัพย์ในกลุ่มประเทศ G7. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิตมหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. (2531). การวิเคราะห์อนุกรมเวลา. มหาสารคาม : คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ.
- ศันสนีย์ เทพปัญญา. (2552). โกลด์อีทีเอฟ. Executive Journal มหาวิทยาลัยกรุงเทพ. 83-89.

- สมลักษณ์ บุญโกมล. (2550). การเปรียบเทียบผลการดำเนินงานจากการลงทุนในกองทุนรวม
 จำแนกตามนโยบายการลงทุน. สารนิพนธ์ คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ.
 อภิขญา เทียนชัยโรจน์. (2552). การเปรียบเทียบผลตอบแทนจากการลงทุนในทองคำแท่ง (Gold
 Billion) กองทุนรวมทองคำและกองทุนรวมน้ำมัน. งานวิจัยเฉพาะเรื่องคณะเศรษฐศาสตร์
 มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- อภิสิทธิ์ สรรพดิถก. (2548). การส่งผ่านความไม่แน่นอนของปัจจัยที่มีผลในตลาดซื้อขายไฟฟ้า
 จากประสบการณ์ของต่างประเทศโดยใช้วิธีแบบจำลอง MULTIVARIATE GARCH.
 วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- Araya Kanjanatarakul. (2008). **Relationship between export volumes volatility and
 exchange rate volatility of Thailand.** Independent Study Master of Economics. Chiang
 Mai University.
- Bollerslev, T. (1986). **Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity.** Journal
 of Econometrics 31 : 307 - 327
- Chaiwat Nimanussornkul. (2009). **Modelling stock and bond returns and volatility in South-
 East Asian Countries.** Doctor's Thesis Economics. Chiang Mai University.
- 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
- M.P. Visser. (2009). **Volatility Proxies and GARCH model.** Thesis of Science. University of
 Amsterdam.