

เอกสารอ้างอิง

ทัศนีย์ คำมงคล.(2552).การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างราคาน้ำมันดูไบกับผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศไทย.การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย, รายชื่อบริษัทจดทะเบียนที่อยู่ในหมวดธุรกิจพลังงาน.

ข้อมูลออนไลน์, เข้าถึงได้จาก: <http://www.set.or.th/th/company/companylist.html>
(วันที่ค้นข้อมูล: 3 มีนาคม 2555)

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. (2547). เศรษฐมิตติ: ทฤษฎีและการประยุกต์.เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

นิติวัธน์ ดวงงาม. (2552). แบบจำลองการส่งผ่านความผันผวนและความสัมพันธ์แบบมีเงื่อนไขระหว่างตลาดหลักทรัพย์และตลาดพันธบัตรของประเทศไทยและประเทศสิงคโปร์.การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

บริษัทเซตเทรด ดอทคอมจำกัด,สรุปดัชนีหลักทรัพย์แยกตามอุตสาหกรรม. รายงาน, ข้อมูลออนไลน์ เข้าถึงได้จาก: http://www.settrade.com /C13_MarketSummary.jsp?detail=INDUSTRY
(วันที่ค้นข้อมูล: 3 มีนาคม 2555)

ปิยนุช เรืองขจร.(2550).การประมาณค่าความผันผวนของผลตอบแทนของราคาน้ำมันดิบ ถ่านหิน และก๊าซธรรมชาติ. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ประไพศรี ทิพย์แก้ว.(2552).การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ของความผันผวนระหว่างอัตราผลตอบแทนดัชนีหลักทรัพย์กลุ่มพลังงาน และกลุ่มขนส่งในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

พัทธพร ไชยศรี.(2553).การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาทองคำ และราคาน้ำมันในตลาดปัจจุบันและตลาดล่วงหน้าของโลก.การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

พัญนิยา พังนิตนกรณ์.(2552).ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนและ ความผันผวนของการนำเข้าน้ำมันดิบของประเทศไทยการค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. (2531). การวิเคราะห์อนุกรมเวลา. มหาสารคาม: คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ.

- Bollerslev, T. (1986). **Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity**. Journal of Econometrics 31 : 307 - 327
- 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. (2002). **Dynamic conditional correlation: A simple class of multivariate generalized autoregressive conditional heteroskedasticity models**. Journal of Business and Economic Statistics, 20, pp. 339-350.
- Gorssman, Sandy and Joseph Stiglitz.(1980). **On the impossibility of informationally efficient markets**. American Economic Review 70 :393 - 408
- McAleer, M., Hoti, S. and Chan, F. (2009). **Structure and asymptotic theory for multivariate asymmetric conditional volatility**. Econometric Reviews 28, 442 – 440.
- M.P. Visser. (2009). **Volatility Proxies and GARCH model**. Thesis of Science. University of Amsterdam
- Tansuchat, R. (2009). **Volatility spillovers between crude oil futures returns and oil company stock returns**. Faculty of Economic. Chiang Mai University and Maejoe University.