

## เอกสารอ้างอิง

- กฤษฎา พงษ์ประพนธ์. 2553. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราผลตอบแทนจากดัชนีราคาสินค้าโภคภัณฑ์ของจิม โรเจอร์ส และดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยใช้แบบจำลอง วาร์มาร์กซ์ และวาร์มาเอการซ์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิราธิป ชนะชัย. 2553. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหุ้นกลุ่มพลังงานโดยวิธี ควอนไทล์ รีเกรสชัน. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย. 2554. แนะนำองค์กร. แหล่งที่มา : <http://www.afet.or.th/v081/thai/corporate/introduction.php> (25 เมษายน 2555)
- ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย. 2552. ข้าวหอมมะลิไทย. กรุงเทพฯ: ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย.
- ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย. 2552. ชื้อขายข้าวล่วงหน้าใน AFET. กรุงเทพฯ: ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย.
- ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย. 2553. มองอนาคตข้าวไทยในปี 2554. กรุงเทพฯ: ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย.
- ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย. 2552. เราจะใช้ประโยชน์จาก AFET ได้อย่างไร. กรุงเทพฯ: ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย.
- ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย. 2552. ลงทุนอย่างไรใน AFET. พิมพ์ครั้งที่ 3. กรุงเทพฯ: ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตติ: ทฤษฎีและการประยุกต์. พิมพ์ครั้งที่ 1. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ธีระวุฒิ ธีตรานนท์. 2550. การวิเคราะห์ความเสี่ยงด้านราคาและการส่งผ่านราคาของยางแผ่นรมควันชั้น 3 จากตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทยสู่ตลาดปัจจุบันของประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปิยนุช เรืองขจร. 2550. การประมาณค่าความผันผวนของผลตอบแทนของราคาน้ำมันดิบ ถ่านหิน และก๊าซธรรมชาติ โดยวิธี อาร์มาอีการซ์ อาร์มาการซ์เอ็ม และอาร์มาการซ์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

ปรีชา มหารันต์. 2554. การสร้างแบบจำลองราคาทองคำแท่งในประเทศไทยโดยใช้วิธีควอนไทล์เกรสชันแบบมีเงื่อนไข. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

บุญธิดา ศรีเขียวใส. 2554. การวิเคราะห์ความผันผวนของอัตราผลตอบแทนของราคาปัจจุบันยางพาราของประเทศในเอเชียตะวันออกเฉียงใต้. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ศุภชัยรัตน์ ภาสกรพิพัฒน์กุล. 2544. ความสัมพันธ์ระหว่างราคายางพาราตลาดส่งมอบทันทีในประเทศไทย กับราคาตลาดล่วงหน้าในต่างประเทศ. วิทยานิพนธ์ วิทยาศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

พริยา ชูฒยากร. 2547. ความสัมพันธ์ระหว่างราคาข้าวตลาดส่งมอบทันทีในประเทศไทยกับราคาข้าวตลาดล่วงหน้าในต่างประเทศ. วิทยานิพนธ์ วิทยาศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

รหัท รวมพรรณพงศ์. 2550. ประสิทธิภาพราคาในตลาดน้ำมันปาล์มของประเทศไทย.

วิทยานิพนธ์ วิทยาศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

ราคาส่งออกข้าวสารไทย F.O.B กรุงเทพฯ. แหล่งที่มา :

[http://www.thairiceexporters.or.th/List\\_%20of\\_statistic.htm](http://www.thairiceexporters.or.th/List_%20of_statistic.htm) (10 มิถุนายน 2555)

ราคาข้าวเปลือกเจ้านาปี ข้าวเปลือกหอมมะลิ ข้าวเหนียว ที่เกษตรกรขายได้. แหล่งที่มา :

[http://www.oae.go.th/oae\\_report/price/price\\_month.php](http://www.oae.go.th/oae_report/price/price_month.php) (20 พฤษภาคม 2555)

ศูนย์พัฒนาความรู้การซื้อขายสินค้าเกษตรล่วงหน้า. 2552. ความสัมพันธ์ของราคาสินค้าเกษตรในตลาดจริง (Cash Price) กับราคาในตลาดล่วงหน้า (Futures Price). แหล่งที่มา :

[http://www.aftc.or.th/itc/analyze\\_1\\_7.php](http://www.aftc.or.th/itc/analyze_1_7.php) (10 มิถุนายน 2555)

ศูนย์วิจัยธุรกิจและเศรษฐกิจอีสาน. 2554. สถานการณ์และแนวโน้มการส่งออกข้าวและผลิตภัณฑ์ของไทยสิ้นปี 2554 จำแนกตามรหัสสินค้า 10 digits. ขอนแก่น: คณะวิทยาการจัดการ มหาวิทยาลัยขอนแก่น.

สำนักงานเศรษฐกิจการเกษตร. 2554. สถานการณ์สินค้าเกษตรที่สำคัญและแนวโน้ม ปี 2555.

กรุงเทพฯ: สำนักงานเศรษฐกิจการเกษตร กระทรวงเกษตรและสหกรณ์.

สำนักงานเศรษฐกิจการเกษตร. 2554. สถิติการเกษตรของประเทศไทย ปี 2554. กรุงเทพฯ:

สำนักงานเศรษฐกิจการเกษตร กระทรวงเกษตรและสหกรณ์.

สำนักงานเศรษฐกิจการเกษตร. 2555. ระบบแสดงข้อมูลด้านสถิติ. กรุงเทพฯ:

สำนักงานเศรษฐกิจการเกษตร กระทรวงเกษตรและสหกรณ์.

อัจฉราวรรณ งามญาณ. 2546. ตลาดซื้อขายสินค้าเกษตรล่วงหน้า. กรุงเทพฯ: คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

อัญญา ชันชวิทย์. 2547. การวิเคราะห์ความเสี่ยงจากการลงทุนในหลักทรัพย์. พิมพ์ครั้งที่ 1. กรุงเทพฯ : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.

อารี วิบูลย์พงศ์. 2532. การวิเคราะห์การตลาดเกษตร. เชียงใหม่: คณะเกษตรศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

Colin (Lin) Chen, SAS Institute Inc., Cary, NC. April 10-13, 2005. **An Introduction to Quantile Regression and the QUANTREG Procedure.** Philadelphia, Pennsylvania.

Joshua D. Angrist and Jorn-Steffen Pischke. 2009. **Mostly Harmless Econometrics An Empiricist's Companion.** United States of America.

Kuo, H.W., et al. 2008. "Foreign investment, regulation, volatility spillovers between the futures and spot markets: evidence from Taiwan." **Applied Financial Economics** 18: pp. 421-430.

Ruey S. Tsay. 2005. **Analysis of Financial Time Series.** 2<sup>nd</sup> ed. United States of America.