

เอกสารอ้างอิง

- จุฑามาศ สุพรจักร. 2552. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ของอัตราผลตอบแทนของดัชนีราคา
หลักทรัพย์ล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ไทย สหรัฐอเมริกา ญี่ปุ่น และฮ่องกง. การค้นคว้า
แบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิตติศักดิ์ กิตติศักดิ์ธาดากุล. 2552. ผลกระทบความสัมพันธ์ของเงินเฟ้อและอัตราแลกเปลี่ยนของ
จำนวนนักท่องเที่ยวต่างชาติที่เข้ามาเที่ยวในประเทศไทย โดยวิธี มัลติโวลเรียเทกการซ์.
การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ณิชา พุศรีนวล. 2552. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างความสัมพันธ์ของอัตราเงินเฟ้อ และ
อัตราดอกเบี้ยของประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. ข้อมูลสถิติสำคัญของตลาดอนุพันธ์ TFEX. [ระบบออนไลน์]
http://www.set.or.th/static/mktstat/TFEX_Statistics_th_TH.xls (26 กุมภาพันธ์ 2552).
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- นนทลี ศรีสว่าง. 2552. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราเงินเฟ้อและการว่างงานของ
ประเทศไทย โดยวิธี ไบวารรีเทกการซ์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- นิติวัธน์ ดวงงาม. 2552. แบบจำลองการส่งผ่านความสัมพันธ์และความสัมพันธ์แบบมีเงื่อนไข
ระหว่างตลาดหุ้นและตลาดพันธบัตรของประเทศไทยและประเทศสิงคโปร์. การค้นคว้า
แบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วรรณ นุญปลอด. 2551. การเปรียบเทียบผลตอบแทนจากการลงทุนโดยการวิเคราะห์ทางเทคนิค
ในตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วิสูตร พาราทิพย์เจริญชัย. 2551. ประสิทธิภาพและแบบจำลองสำหรับการประมาณค่าอัตรา
ความเสี่ยงที่เหมาะสมโดยใช้ดัชนีราคาหลักทรัพย์ล่วงหน้า: กรณีศึกษาของประเทศไทย.
วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

อภิสิทธิ์ สรรพดิกลก. 2548. การส่งผ่านความไม่แน่นอนของปัจจัยที่มีผลในตลาดซื้อขายไฟฟ้าจาก
 ประเทศต่าง ๆ โดยใช้วิธีแบบจำลอง MULTIVARIATE GARCH.

วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

Bollerslev, T; Engle, R and Wooldridge, J. 1988. "A capital asset pricing model with time-varying covariances." **Journal of Political Economy** 96 (1): 116-131.

Damodar N.Gujarati and Dawn C. Porter. 2009. **Basic Econometrics**, 5th edition, McGraw-Hill.

Dirk Baur. 2006. "A Flexible Dynamic Correlation Model." **Advances in Econometrics**, Vol.20.

Ender, Walter. 2004. **Applied Econometric Time Series**. 2nd edition. New York: John Wiley and sons.

Engle, R.F. 2002. "Dynamic conditional correlation: anew simple class of multivariate GARCH models." **Journal of Business and Economic Statistics** 20: 339-350.

Engle, R.F. and Kroner, K. 1995. "Multivariate simultaneous generalised ARCH." **Econometric Theory** 11: 122-150.

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

Reuter. 2007. Reuters Kobra TM Version 3.5.1. Available: Finance And Investment Center, Chiang Mai University (22 May 2010).

Tsay, Ruey. 2005. **Analysis of financial time series**. 2nd edition. New York: John Wiley and sons.

Tse, Y.K. & Tsui, K.C. 2002. "A multivariate generalized autoregressive conditional heteroscedasticity model with time-varying correlations." **Journal of Business and Economic Statistics** 20: 351-362.