

เอกสารอ้างอิง

- กฤษฎา พงษ์ประพนธ์. 2553. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราผลตอบแทนจากดัชนีราคาสินค้าโภคภัณฑ์ของจิม โรเจอร์ และดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยใช้แบบจำลองวาร์มาการซ์ และวาร์มาเอการซ์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ชาตยณรงค์ ชัยพัฒน์. 2546. การศึกษาปัจจัยที่มีผลกระทบต่อการเคลื่อนย้ายเงินในบัญชีเงินทุนของประเทศไทย : รายงานการวิจัยฉบับสมบูรณ์. กรุงเทพฯ: สำนักงานกองทุนสนับสนุนการวิจัย.
- ฐิติศักดิ์ กิตติศักดิ์ธาดากุล. 2552. ผลกระทบของความผันผวนของเงินเฟ้อและอัตราแลกเปลี่ยนของจำนวนนักท่องเที่ยวต่างชาติที่เข้ามาเที่ยวในประเทศไทย โดยวิธีจำลองทอวาริเอทการซ์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ณัฐพล ถั่วเหล็ก. 2553. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับการลงทุนโดยตรงในประเทศไทยจากประเทศญี่ปุ่น ฮองกง และสิงคโปร์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- นันทน์ภัส เลิศจรยารักษ์. 2548. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างตัวแปรเศรษฐกิจมหภาคและการลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศในประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ณิชา พุศรีนวล. 2552. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราเงินเฟ้อและอัตราดอกเบี้ยของประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. เศรษฐมิตติ: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- พรชัย ชุนหจินดา. 2545. การบริหารการเงินระหว่างประเทศ. กรุงเทพฯ: มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ภูวคัล ทิมะณี. 2552. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราดอกเบี้ยกับการลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศโดยวิธีไบวาร์ริเอทการซ์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

รังสรรค์ หทัยเสรี และ ชัชวรัตน์ มุสิกไชย. 2543. “เงินทุนเคลื่อนย้ายระหว่างประเทศและกลยุทธ์นโยบายการเงินหลังวิกฤตเศรษฐกิจเอเชีย: ประเด็นปัญหาและนัยต่อเครื่องมือบริหารจัดการเงินทุนของไทย.”การสัมมนาทางวิชาการประจำปี 2543 เรื่องนโยบายการเงินไทยในศตวรรษที่ 21. กรุงเทพฯ: ธนาคารแห่งประเทศไทย.

รัตนา สายคณิต. 2546. **หลักเศรษฐศาสตร์ II มหเศรษฐศาสตร์**. พิมพ์ครั้งที่ 3. กรุงเทพฯ: จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

วิมล ปันคง. 2545. **ผลกระทบจากความเสถียรของอัตราแลกเปลี่ยนและส่วนต่างอัตราดอกเบี้ยต่อเงินทุนไหลเข้าจากต่างประเทศ**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ศนิธิ รัตนสุรงค์. 2551. **ผลกระทบจากการลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศที่มีต่อการเจริญเติบโตทางเศรษฐกิจของกลุ่มประเทศอาเซียน**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

สไบทิพย์ ไคร้อยงค์. 2553. **ผลกระทบของเงินทุนเคลื่อนย้ายระหว่างประเทศภาคเอกชนที่มีต่อตัวแปรทางการเงิน การบริโภคและการลงทุนภาคเอกชนของประเทศไทย**. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

สุชาติ กิตติธรรมจริยา. 2540. **การทดสอบ Fisher Effect กรณีประเทศไทย**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย. (17 มีนาคม 2553)

Bollerslev, T. 1986. “Generalised autoregressive condition heteroscedasticity.” **Journal of Econometrics** 31: 307-327

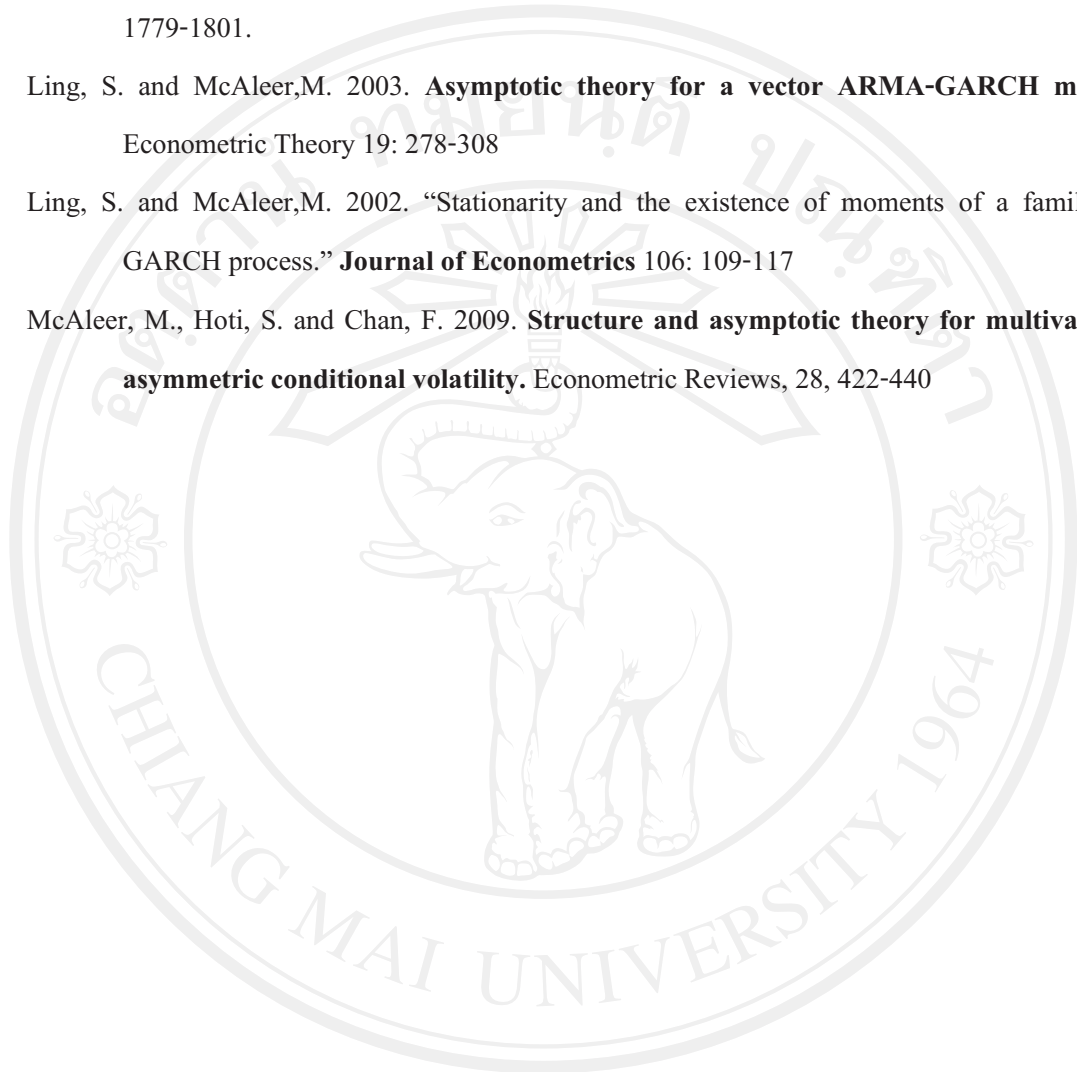
Bollerslev, T. 1990. “Modelling the coherence in short run nominal exchange rates: a multivariate generalized ARCH approach.” **Review of Econometric and Statistics** 72: 498-505.

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. 2004. **Applied Econometric Time Series**. Second 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 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.
- 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



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved