

เอกสารอ้างอิง

- กัลยา วิณิชย์บัญชา. 2552. การวิเคราะห์ข้อมูลหลายตัวแปร. พิมพ์ครั้งที่ 4. กรุงเทพมหานคร: สำนักพิมพ์จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- กัลยาณี เจริญกิจหัตถกร. 2548. ความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์สหรัฐอเมริกา. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ไทร เอื้ออภิสิทธิ์วงศ์. 2550. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกับดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์ที่สำคัญของโลก. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ธนาศักรี้ ดันดินาคม. 2539. ปัจจัยเชิงเศรษฐศาสตร์ที่มีผลต่อดัชนีราคาตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สถลทิพย์ ศิริไพบุลย์. 2545. ปัจจัยที่กำหนดดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยระหว่างปี ค.ศ. 1995-2001. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เสกสรร เกียรติสุไพบุลย์. 2552. เอกสารประกอบการสอนวิชาการจำลองเชิงสถิติ. กรุงเทพมหานคร จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- Dias, A. and P. Embrechts. 2004. **Dynamic copula models for multivariate high-frequency data finance**. ETH working paper.
- Embrechts, P. 2009. "Copulas: A Personal View." *Journal of Risk and Insurance*, 76(3): 639-650.
- Joe, H. 1997. **Multivariate models and dependence concepts**. London, Chapman and Hall.
- Joe, H. and J.J. Xu. 1996. **The Estimation Method of Inference Functions for Margins for Multivariate Models**. Technical Report 166. Department of Statistics, University of British Columbia.
- Jondeau, E. and M. Rockinger. 2006. "The copula-GARCH model of conditional dependencies: An international stock market application." *Journal of International money and Finance* 25:827-853.

Nelsen, R.B. 2006. **An Introduction to Copulas**, Springer Science+Business Media, Inc.

Patton, A.J. 2006, “**Estimation of multivariate models for time series of possibly different lengths.**” JOURNAL OF APPLIED ECONOMETRICS 21(2): 147-137.

Patton, A.J. 2006. “**Modelling Asymmetric Exchange Rate Dependence.**” International Economic Review 47(2): 527-556

Rodriguez, J.C., 2007, **Measuring financial contagion: a copula approach.** Journal of Empirical Finance, 14(3), 401-423

Sklar, A. 1959. **Function de repartitions a n dimension et leur marges.** Publications de l’Institut de Statistique de L’Universite de Paris.

World Bank. 2012. **World Bank Data.** Available: <http://databank.worldbank.org/ddp/home.do>
(April 18, 2012)

lengths.” JOURNAL OF APPLIED ECONOMETRICS 21(2): 147-137.

Patton, A.J. 2006. “**Modelling Asymmetric Exchange Rate Dependence.**” International Economic Review 47(2): 527-556

Rodriguez, J.C., 2007, **Measuring financial contagion: a copula approach.** Journal of Empirical Finance, 14(3), 401-423

Sklar, A. 1959. **Function de repartitions a n dimension et leur marges.** Publications de l’Institut de Statistique de L’Universite de Paris.

World Bank. 2012. **World Bank Data.** Available: <http://databank.worldbank.org/ddp/home.do>
(April 18, 2012)