CONTENTS

LIST OF TABLES

Page

LIST OF FIGURES

Page

ข้อความแห่งการริเริ่ม

1) งานวิจัยนี้ได้ประยุกต์ใช้คอปปูลาภายใต้แบบจำลองอาร์มาการ์ชเพื่อศึกษาความสัมพันธ์ระหว่างตัวแปรทางเศรษฐกิจ ราคาอาหารหรือราคาสินค้าเกษตร และราคาพลังงาน ซึ่งเกี่ยวข้องกับราคาอาหารและราคาพลังงานในภูมิภาคอาเซียน

2) เพื่อที่จะปรับปรุงความแม่นยำของการวิเคราะห์ความสัมพันธ์ คอปปูลาภายใต้แบบจำลองอาร์มาการ์ชจึงถูกใช้ เนื่องจากข้อมูลของตัวแปรแต่ละตัวในงานวิจัยนี้ได้แสดงให้เห็นหลักฐานของการกระจายที่ไม่ปกติ ดังนั้นการวัดความสัมพันธ์โดยใช้คอปปูลาภายใต้แบบจำลองอาร์มาการ์ช จึงมีความเหมาะสมมากกว่าวิธีการแบบเดิม

3) ผลการศึกษาของงานวิจัยนี้มีประโยชน์สำหรับการกำหนดนโยบายการพัฒนาเศรษฐกิจและสังคมในระดับมหภาคของภูมิภาคอาเซียนและการจัดการความเสี่ยงในการค้าระหว่างประเทศและตลาดการเงิน

STATEMENT OF ORIGINALITY

1) This research applied the copula based ARMA-GARCH model to study the relationship between economic variables, food prices or agricultural commodity prices, and energy prices, which are related to the prices of food and energy in the ASEAN region.

2) In order to improve the accuracy of the relationship analysis, the copula based ARMA-GARCH model is used. Since the data of each variable in this research exhibited evidence of non-normal distribution therefore measuring the relationship by using the copula based ARMA-GARCH model is more appropriate than the conventional approach.

3) The results of this research are useful for the formulation of social and economic development policy at the macro-level of the ASEAN region, and risk-management in the international trade and financial markets.