

เอกสารอ้างอิง

จุฑาภรณ์ เวชมนัส (2552) ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับราคาหลักทรัพย์ของกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ .

ณพล หงสกุลวสุ (2550) ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนของอัตราดอกเบี้ย ความผันผวนอัตราเงินเฟ้อ ความผันผวนของอุปทานทางการเงิน และความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนที่มีผลต่อทุนเคลื่อนย้ายการค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ .

ไตรทศ กลิ่นอุทัย (2552) ความสัมพันธ์ระหว่างการเปลี่ยนแปลงอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศกับการเปลี่ยนแปลงราคาหลักทรัพย์ของกลุ่มขนส่งและโลจิสติกส์ในตลาดหลักทรัพย์ทั้งระยะสั้นและระยะยาวการค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ .

นฤมล เขาวนวิฑูร (2542) ความสัมพันธ์ระหว่างความผันผวนในตลาดอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศกับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ .

สิรินธร คำตันสมบัติ (2552) ความสัมพันธ์ของการเปลี่ยนแปลงอัตราแลกเปลี่ยนที่มีผลต่อราคาหลักทรัพย์ของกลุ่มอสังหาริมทรัพย์และก่อสร้างในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ .

สำนักข่าว Bloomberg (2553) Foreign portfolio investment in equity

สำนักข่าว Biznews ประเทศไทย (2553) ข้อมูลสถิติการซื้อขายสุทธิของนักลงทุนต่างประเทศในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

อัญญาภรณ์ กันธามณี (2547) ปัจจัยที่กำหนดการลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศโดยใช้เทคนิคโคอินทิเกรชันและแบบจำลองเอเรอร์คอร์เรคชัน เลือกศึกษาเงินทุนโดยตรงจากประเทศญี่ปุ่นและสหรัฐอเมริกา การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ .

อุษษา แพทย์เจริญ (2552) ความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนสกุลเงินบาทต่อดอลลาร์สหรัฐกับดัชนีหมวดธุรกิจในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Enders, Walter. 1995. **Applied econometric time series** . New York : John Wiley & Sons.

Engle,R.W. and Granger , C.W.J. 1987 “**Cointegration and Error orrection:Representation. Estimation and Testing.**” *Econometrica* 55:251-276.

Fama, E.F. 1970. “**Efficien capital markets: a review of theory and empirical work**” *Journal of Finance*. 25: 383-417 .

Gujarati, D.N. 2003. **Basic economic** New York:McGraw-Hill.

Johansen, s. 1988. “**Statistical analysis of cointegration vector.**” *Journal of Economic Dynamics and Control* no. 12

Krugman, P. 1997. **Currency Crises**. Aailable:<http://web.mit.edu/krugman/www/>

MacDonald, Ronald. 1995. “Long-Run Exchange Rate Modeling : A Survey of the Recent Evidence” *IMF Staff Papers* 42,3 (September) : 437-483.

- MacDonald, R. and Taylor, M.P. 1995. "The Monetary Model of the exchange Rate : Long-Run Relationship, Short-Run Dynamic and How to Beat a Random Walk." **Journal of International Money and Finance** 13: 276-290.
- Masson, Paul. 2000. "Contagion : monsoonal effect, spillover and jumps between Multiple equilibria." In **The Asian Financial Crisis : Causes, Contagion and Consequences**. Pp.265-278. Edited by Pierre-Richard Agenor; Marcus Miller; David Vines and Axel Weber. Cambridge: Cambridge University Press.
- Patterson, K. 2000 . **An introduction to applied econometrics**. London : Macmilan .
- Sims. 1980. "Macroeconomics and Reality ." *Econometrica*. 48:1-49 .
- Stock, J. and Watson. 1988 "Variable trend in economic time series " *Journal of economic Perspective* 2:147-175.
- Taylor,E,Bessler,D.; Waller,M. and Rister, M. 1996 "Dynamic relationship between Us and Thai rice prices" *Agricultural Economics*,Balckwell, 14: 123-14.
- Tipwan Wannasophon. 1997. **Impacts of foreign investment on the thai stock market : VAR analysis**. Master'sthesis. Faculty of Economics. Thammasat University.