

บรรณานุกรม

หนังสือและบทความในหนังสือ

ณัฐพล ขวลิขิตวิน และกอบชัย จิมกุล, การบริหารการลงทุนในตราสาร. พิมพ์ครั้งที่หนึ่ง.
กรุงเทพมหานคร:สำนักวิจัยตลาดทุน บริษัทเงินทุนอุตสาหกรรมแห่งประเทศไทย,
2540.

สถาบันพัฒนาความรู้ตลาดทุน ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย, การประเมินมูลค่าสินทรัพย์
การลงทุนในตราสารหนี้. พิมพ์ครั้งที่หนึ่ง. กรุงเทพมหานคร: บริษัท อมรินทร์พริ้นติ้ง
แอนด์พับลิชชิ่ง, 2548.

อัญญา ชันธวิทย์, การวิเคราะห์การลงทุนในตราสารหนี้. พิมพ์ครั้งที่หนึ่ง. กรุงเทพมหานคร:
โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2541.

เอกสารอื่นๆ

จักรพงษ์ นามบัณฑิต. “การลดความเสี่ยงของอัตราผลตอบแทนพันธบัตรจากการเปลี่ยนแปลง
อัตราดอกเบี้ย.” ภาคนิพนธ์ มหบัณฑิต คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ(เศรษฐศาสตร์
ธุรกิจ) สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์, 2547.

อนุวัชร ศิริรัตน์. “การทดสอบกลยุทธ์การสร้างภูมิคุ้มกันจากความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ยของหุ้นกู้
พันธบัตรรัฐบาล และพันธบัตรรัฐวิสาหกิจในประเทศไทย.” วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์
มหบัณฑิต คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.

สื่ออิเล็กทรอนิกส์

สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย. “การประเมินผลการดำเนินงานของพอร์ตโฟลิโอ (Portfolio
Evaluation)”. <<http://www.thaibma.or.th>>.

สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย. “กลยุทธ์การจัดพอร์ตตราสารหนี้”. <<http://www.thaibma.or.th>>.

Articles

Bierwag, G.O.; Kaufman, George G.; and Latta, Cynthia M. “Bond Portfolio Immunization: Tests of Maturity, One and Two-Factor Duration Matching Strategies.” The Financial Review 22 (1987):203-219.

Bierwag, G.O.; Kaufman, George G.; Schweitzer, Robert.; and Toevs, Alden. “The Art of Risk Management in Bond Portfolios.” The Journal of Portfolio Management 7 (1981):27-36.

Christensen, Peter Ove; and Sorensen, Bjane G. “Duration, convexity, and time value.” Journal of Portfolio Management 20 (1994):51-60.

Fong, Gifford H. and Vasicek, Oldrich A. “A Risk Minimizing Strategy for Portfolio Immunization.” Journal of Finance 39 (1984):1541-1546.

Ingersoll, Jonathan E. “Is Immunization Feasible? Evidence from the CRSP Data.” Innovations in Bond Portfolio Management (1983): 82-163.

Kritzman, Mark. “What Practitioners Need To Know.....About Duration and Convexity.” Financial Analysts Journal 48 (1992):17-20.

Nawalkha, Sanjay K. “Closed-Form Solutions of Convexity and M-Square.” Financial Analysts Journal 46 (1990):75-77.

Nawalkha, Sanjay K.; and Chambers, Donald R. "An Improved Immunization Strategy: M-Absolute." Financial Analysts Journal 52 (1996):69-76.

Reilly, Frank K.; and Sidhu, Rupinder S. "The Many Uses of Bond Duration." Financial Analysts Journal 36 (1980):58-72.

Books

Fabozzi, Frank J., Bond Markets, Analysis and Strategies. 6th ed. New Jersey: Prentice Hall, 2007.

Ho, Thomas S.Y., Fixed Income Solutions: New Techniques for Managing Market Risks. Chicago: IRWIN Professional Publishing, 1996.

Mishkin, Frederic S. and Eakins, Stanley G., Financial Markets & Institutions. 5th ed. Pearson International Edition, 2006.

Nawalkha, Sanjay K.; Soto, Gloria M.; and Beliaeva, Natalia A., Interest Rate Risk Modeling. New Jersey: John Wiley & Sons, Inc., 2005.

Other Materials

Claus Munk. "Fixed Income Analysis: Securities, Pricing, and Risk Management". <<http://www.sam.sdu.dk/~cmu>>. January 2005.

Israelsen, Craig L. "Sharpening the Sharpe Ratio". <<http://www.financial-planning.com/pubs/fp/20030101012.html>>. January 2003.