

บรรณานุกรม



บรรณานุกรม

- กาญจน์ กังวานพรศิริ (2552) “การจัดการกองทุนรวม” ใน ประมวลสาระชุดวิชาสัมมนาการจัดการการเงิน หน่วยที่ 15 นนทบุรี มหาวิทยาลัยสุโขทัยธรรมาธิราช สาขาวิชาวิทยาการจัดการ _____ . (2553) “วางแผนชีวิต วางแผนการเงิน บริหารความเสี่ยงของชีวิต” วารสารการจัดการความรู้ ฉบับที่ 1, 8 กุมภาพันธ์ นนทบุรี มหาวิทยาลัยสุโขทัยธรรมาธิราช สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์ _____ . (2554) “การจัดการการลงทุนในกลุ่มหลักทรัพย์” ใน ประมวลสาระชุดวิชาเศรษฐศาสตร์การเงินและการจัดการทางการเงิน หน่วยที่14 นนทบุรี มหาวิทยาลัยสุโขทัยธรรมาธิราช สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์
- กิตติพันธ์ คงสวัสดิ์เกียรติ (2552) *การจัดการความเสี่ยงและตราสารอนุพันธ์เบื้องต้น* พิมพ์ครั้งที่ 2 สำนักพิมพ์เพียร์สัน เอ็ดดูเคชั่น
- คณะกรรมการพัฒนาตลาดทุนไทย (2552) เอกสาร “แผนพัฒนาตลาดทุนไทย” ธนาคารแห่งประเทศไทย
- จิระพล โปบุคคี และชนานันท์ ศิวโมกษธรรม (2554) “การประเมินมูลค่าตราสารทางการเงิน อัตราผลตอบแทน และความเสี่ยง” ใน ประมวลสาระชุดวิชาสัมมนาการจัดการการเงิน หน่วยที่ 11 นนทบุรี มหาวิทยาลัยสุโขทัยธรรมาธิราช สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์
- จิรัตน์ สัจจ์แก้ว (2544) *การลงทุน* พิมพ์ครั้งที่ 4 กรุงเทพมหานคร สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
- ทวีวรรณ ปิ่นโต (2553) *การลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ* ฝ่ายกำกับการแลกเปลี่ยนเงินและสินเชื่อ ธนาคารแห่งประเทศไทย
- ชนัยวงศ์ กิริตวานิชย์ และภัสรา ชวาลกร (2549) *รู้วิเคราะห์เจาะเรื่องกองทุนรวม ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย* กรุงเทพมหานคร บริษัทอมรินทร์พริ้นติ้งแอนด์พับลิชชิ่ง จำกัด
- นาถลดา กำลังเสื่อ (2550) “นโยบายอัตราแลกเปลี่ยนศึกษาตามแนวคิดความกดดันของอัตราแลกเปลี่ยน” วิทยานิพนธ์มหาบัณฑิต คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
- นภาพร แซ่เตียว (2550) “การดำเนินนโยบายการเงินผ่านช่องทางอัตราแลกเปลี่ยนและผลกระทบต่อระบบเศรษฐกิจไทย” วิทยานิพนธ์มหาบัณฑิต คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์

- นรเศรษฐ ศรีธาน (2551) *การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนจากการลงทุนในหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ด้วยเทคนิค Value at Risk (VaR)*. รายงานวิจัย สาขาวิชาการเงิน คณะบริหารธุรกิจ วิทยาลัยนอร์ทกรุงเทพ
- นาฏธิดา เหล่าพงศ์หาญ (2548) “การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนสำหรับการตัดสินใจในการลงทุนส่วนบุคคล” การค้นคว้าแบบอิสระ สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์ คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยมหามกุฏราชวิทยาลัย วิทยาเขตมหานครราชบุรี
- พันทิพา เหลืองสุวรรณ (2545) “ความเสี่ยงและผลตอบแทนจากการลงทุนในสินทรัพย์การเงิน” การศึกษาค้นคว้าด้วยตนเอง สาขาเศรษฐศาสตร์ ภาควิชาเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์
- รังสรรค์ หทัยเสรี (2538) “Cointegration and Error Correction Approach: ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของไทย” วารสารเศรษฐศาสตร์ ธรรมศาสตร์ ปีที่ 13 ฉบับที่ 3 (กันยายน): 20-51
- มานพ มาตั้งคสมบัติ (2546) “ผลตอบแทนและความเสี่ยงจากการลงทุนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้และกองทุนรวมตราสารทุน” ภาคนิพนธ์คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์
- มนตรี สุคนธมาน (2550) “การจัดสัดส่วนการลงทุนส่วนบุคคล” การค้นคว้าแบบอิสระ สาขาวิชาการบริหารธุรกิจ คณะบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยมหามกุฏราชวิทยาลัย วิทยาเขตมหานครราชบุรี
- มหาวิทยาลัยสุโขทัยธรรมมาธิราช (2548) “การลงทุนในตราสารทางการเงิน” ใน เอกสารการสอนชุดวิชา สถาบันการเงินและการลงทุน หน่วยที่ 3 นนทบุรี มหาวิทยาลัยสุโขทัยธรรมมาธิราช สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์
- _____ . (2548) “ตราสารทางการเงินและผลตอบแทน” ใน เอกสารการสอนชุดวิชา สถาบันการเงินและการลงทุน หน่วยที่ 2 นนทบุรี มหาวิทยาลัยสุโขทัยธรรมมาธิราช สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์
- _____ . (2550) *เอกสารการสอนชุดวิชา การลงทุน* นนทบุรี มหาวิทยาลัยสุโขทัยธรรมมาธิราช สาขาวิชาวิทยาการจัดการ
- สถาบันพัฒนาความรู้ตลาดทุน ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (2548) *การวิเคราะห์ตราสารอนุพันธ์ อัมรินทร์พรินดีงแอนด์พับลิชชิง*
- สรญา ศรีสกุลดี (2547) “การวิเคราะห์อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงและการวัดผลดำเนินงานจำแนกตามนโยบายการลงทุน” ภาคนิพนธ์พัฒนาการเศรษฐกิจมหามกุฏราชวิทยาลัย คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์

- อัญญา ชันชวิทย์ (2546) การวิเคราะห์ความเสี่ยงจากการลงทุนในหลักทรัพย์ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- อุบลรัตน์ จันทรัมย์ และปานจิตร จิตร์ไพศาล (2552) “การลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศของไทย และผลกระทบจากวิกฤตการเงินโลก” แวนชยายเศรษฐกิจ-สาขนโยบายการเงิน ฉบับที่ 11 กุมภาพันธ์ ธนาคารแห่งประเทศไทย
- Alizadeh, A., & Nomikos, N. (2004). “A Markov regime switching approach for hedging stock indices.” *The Journal of Futures Markets*, 24: 649–674.
- Au-Yeung, S.P. and G.L. Gannon. (2005). “Regulatory Change and Structural Effects in HSIF and HSI Volatility.” *Review of Futures Markets*.
- Baillie, R. T., & Myers, R. J. (1991). “Bivariate GARCH estimation of the optimal commodity futures hedge.” *Journal of Applied Econometrics*, 6: 109–124.
- Bera, A. K., Garcia, P., & Roh, J. S. (1997). “Estimation of time-varying hedge ratios for corn and soybean: BGARCH and random coefficient approaches.” *The Indian Journal of Statistics*, 59: 346–368.
- Brailsford, T., Corrigan, K., & Heaney, R. (2001). “A comparison of measures of hedging effectiveness: A case study using the Australian all ordinaries share price index futures contract.” *Journal of Multinational Financial Management*, 11: 465–483.
- Brooks, C., Henry, O.T. and Persaud, G. (2002). “The Effects of Asymmetries on Optimal Hedge Ratios.” *Journal of Business* 75(2): 333-352.
- Chance, D.M. (2004). *Introduction to Derivatives and Risk Management*. 6th edition. South-Western, Ohio.
- Choudhry, T. (2004). “The effectiveness of constant and time-varying hedge ratios using three Pacific Basin stock Futures.” *International Review of Economics and Finance*, 13: 371-385.
- Chu, Q.C., W. G. Hsieh and Y. Tse. (1999). “Price discovery on the S&P 500 index markets: An analysis of spot index, index futures, and SPDRs.” *International Review of Financial Analysis*, 8(1): 21-34.

- Dunis, Christian L., Laws, Jason., Naim, Patrick. (2003). *Applied Quantitative Methods for Trading and Investment*. England: Wiley.
- Dacco, R., & Satchell, S. (1999). "Why do regime-switching models forecast so badly?" *Journal of Forecasting* 18: 1–16.
- Ferguson, R., & Leistikow, D. (1999). "Futures hedge profit measurement, error-correction model vs. regression approach hedge ratios, and data error effects." *Financial Management*, 28: 118–125.
- Floros, C., & Vougas, D.V. (2006). "Hedging Effectiveness in Greek stock Index Futures Market 1999 – 2001." *International Research of Finance and Economics. Issue 5*.
- Frino, A., T. Walter and A. (2000). West, "The lead-lag relationship between equities and stock index futures markets around information releases." *Journal of Futures Markets* 20(5): 467-487.
- Fabozzi, Frank J. and Franco Modigliani. (2006). *Capital Markets: Institutions and Instruments*. 4th edi., Pearson.
- Fischer, Donald E., and Ronald J. Jordan. (1995). *Security Analysis and Portfolio Management*. Prentice Hall International Editions.
- Ferson, Wayne E., and Rudi W. Schadt. (1996). "Measuring Fund Strategy and Performance in Changing Economic Conditions", *Journal of Finance*. LI, No.2 June, pp. 425-461.
- Gitman, Lawrence J., and Michael D. Joehnk. (2005). *Fundamentals of Investing*. 9th ed. Pearson Addison-Wesley.
- Green, W.H. (2003). *Econometric Analysis*. 5th edition. New York : Prince Hall.
- Gujarati, D. (2003). *Basic Econometrics*. 4th edition. Singapore : McGraw-Hill.
- Heij, C., De Boer, P., Franse, P.H., Kloek, T., Van Dijk. (2004). *Econometric Methods with Applications in Business and Economics*. Oxford University Press.
- Hull, J. (2008). *Options, Futures, and Other Derivatives*. 7th edition. New Jersey : Prince Hall.
- Japan Bank for International Cooperation (JBIC). (2007). "The Structured Bond Market in Thailand", Research Paper No.35, April 2007.
- Jensen, M. C. (1968). "The performance of mutual funds in the period 1945-1964". *Journal of Finance*, 23(2), 389-416.

- Jones, Charles P. (1998). *Investments: Analysis and Management*. 6th ed. New York: John Wiley & Sons.
- Kavussanos, M. G., & Nomikos, N. K. (2000). "Hedging in the freight futures market." *Journal of Derivatives*, 8: 41–58.
- Lee Chang – Few and Rahman Shafiqur. (1990). "Market Timing, Selectivity, and Mutual Fund Performance: An Empirical Investigation". *Journal of Business*, 63, pp. 261–278.
- Lien, D., Tse, Y. K., & Tsui, A. (2002). "Evaluating the hedging performance of the constant correlation GARCH model." *Applied Financial Economics*, 12: 791–798.
- Markowitz, H. M. (1952). "Portfolio Selection." *The Journal of Finance*, 1(1): 77–91.
- Milunovich, G., & Joyeux, R. (2007). *Market Efficiency and Price Discovery in the EU Carbon Futures Market*. Division of Economic and Financial Studies, Macquarie University.
- Min, J.H. and M. Najand. (1999). "A further investigation of the lead-lag relationship between the spot market and spot index futures: Early evidence from Korea." *Journal of Futures Markets*, 19(2): 217–232.
- Newbold, P., and Leybourne, Stephen J. (2003). *Recent Developments in Time Series*. Vol 2 Cheltenham, U.K.: Elgar Reference Collection.
- Reilly, Frank K., and Keith C. Brown. (2003). *Investment Analysis and Portfolio Management*. 7th ed. Thomson South-Western.
- Sharpe, W. F. (1964). Capital asset prices: A theory of market equilibrium under conditions of risk. *Journal of Finance*, 19(3), 425–442.
- _____. (1966). Mutual fund performance. *Journal of Business*, 39(1), 119–138.
- Shimizu, Satoshi. (2008). "Corporate Bond Markets of Korea, Malaysia and Thailand", *Journal of International Economic Studies*. No.22, 71–86.
- Treynor, J. L. (1965). How to rate management of investment funds? *Harvard Business Review*, 43(1), 63–75.
- Tsay, Ruey S. (2005). *Analysis of Financial Time Series*. 2th edition. Hoboken, N.J. : Wiley-Interscience.
- Tse, Y. (1999). "Price discovery and volatility spillovers in the DJIA index and futures markets." *Journal of Futures Markets*, 19(8): 911–930.

Werner, Richard A. (1998). *Capital Market in Thailand: Issues and Opportunities*. Sophia University: Tokyo.

Wooldridge, J.M. (2006). *Introduction Econometrics: A Modern approach*. 3th edition. Mason OH: Thomson-South-Western.

Yang, W. (2001). *M-GARCH Hedge Ratio and Hedging Effectiveness in Australian Futures Markets*. School of Finance and Business Economics, Edith Cowan University.

[http:// www. aimc.or.th](http://www.aimc.or.th)

[http:// www.bangkokbiznews.com](http://www.bangkokbiznews.com)

<http://www.bot.or.th>

[http:// www.chartpatterns.com/headandshoulders.htm](http://www.chartpatterns.com/headandshoulders.htm)

[http:// www.dummies.com/](http://www.dummies.com/)

[http:// www.gotomanager.com](http://www.gotomanager.com)

[http:// www.kasikornasset.com](http://www.kasikornasset.com)

http://pear.veggerbydk/samples/show/id/plot_line

[http:// www.performancetrading.it](http://www.performancetrading.it)

[http:// www.positioningmag.com](http://www.positioningmag.com)

[http:// www.sec.or.th](http://www.sec.or.th)

[http:// www.sharestobuy.com.au/](http://www.sharestobuy.com.au/)

<http://speculator.diaryclub.com>

[http:// stockcharts.com/education/](http://stockcharts.com/education/)

<http://www.set.or.th/>

<http://www.thaibma.or.th/>

[http:// www.thaipost.net](http://www.thaipost.net)

[http:// thaimutualfund.com](http://thaimutualfund.com)

[http:// www.totaltrader.com.au/tag/top-reversal/](http://www.totaltrader.com.au/tag/top-reversal/)