

บรรณานุกรม

หนังสือและบทความในหนังสือ

ชมรมผู้ค้าตราสารหนี้. ความเป็นมา บทบาทของชมรมและสมาชิก ระบบการซื้อขาย ระบบการชำระราคาและส่งมอบ ความรู้ทั่วไปเกี่ยวกับตราสารหนี้. เอกสารอัดสำเนา, 2540.

ประสาร ไตรรัตน์วรกุล. ความจำเป็นและแนวทางในการพัฒนาตลาดทุนไทย. วิทยาลัยป้องกันราชอาณาจักร กรุงเทพฯ, 2546.

วเรศ อุปาติก. เศรษฐศาสตร์การเงินและการธนาคาร. สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2541.

ศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย. ก้าวสู่การลงทุนในตลาดตราสารหนี้. Thai Graphic & Print Co., Ltd., 2544.

ศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย. วิวัฒนาการตลาดตราสารหนี้ไทย. เนื่องในโอกาสครบรอบหนึ่งทศวรรษศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย. บริษัท อมรินทร์พริ้นติ้งแอนด์พับลิชชิ่ง จำกัด (มหาชน), 2547.

อัญญา ชันธวิทย์. การวิเคราะห์การลงทุนในตราสารหนี้. สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2541.

อัญญา ชันธวิทย์. กลไกของตลาดการเงินในระบบเศรษฐกิจไทย. ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย, 2546.

อัญญา ชันธวิทย์. การวิเคราะห์ความเสี่ยงจากการลงทุนในหลักทรัพย์. ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย, 2547.

แนะนำตราสารหนี้ ทีวีความรู้ นักลงทุน. บทความเผยแพร่ โดย ตลาดตราสารหนี้ BEX ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. จัดพิมพ์ครั้งที่ 5, มีนาคม 2549.

เอกสารอื่นๆ

จริยา เปรมศิลป์. “ทางเลือกในการวัดอัตราเงินเฟ้อพื้นฐานสำหรับกรณีของประเทศไทย.”

วิทยานิพนธ์หลักสูตรเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต คณะเศรษฐศาสตร์
มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2548.

ประชา เสงี่ยมชัย. “ปัจจัยกำหนดราคาพันธบัตรรัฐบาลในตลาดรอง.” สารนิพนธ์หลักสูตร

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต (เศรษฐศาสตร์ธุรกิจ) มหาวิทยาลัยรามคำแหง, 2547.

ภัทราภา โตเจริญ. “การศึกษาเปรียบเทียบตลาดตราสารหนี้ไทยกับต่างประเทศ.” การค้นคว้า

อิสระตามหลักสูตรเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชาเศรษฐศาสตร์ บัณฑิต
วิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.

ภาสวรรณ วัฒนสิน. “การกำหนดอัตราดอกเบี้ยของตราสารหนี้ภาคเอกชนในประเทศไทย.”

วิทยานิพนธ์มหาบัณฑิต คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2540.

ยุทธนา กระบวนแสง. “ปัจจัยที่กำหนดการเข้ามาลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.”

สารนิพนธ์หลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต (เศรษฐศาสตร์ธุรกิจ)
มหาวิทยาลัยรามคำแหง, 2546.

วนิดา จริยารเมท. “ปัจจัยกำหนดอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้.” วิทยานิพนธ์หลักสูตร

ปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยรามคำแหง, 2543.

สุชาติ อุบริพุทธิพงศ์. “ผลกระทบของปัจจัยทางเศรษฐกิจที่มีต่อดัชนีตราสารหนี้.” วิทยานิพนธ์

หลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2541.

ข้อมูลจากเว็บไซต์

กระทรวงการคลัง. <<http://www.mof.go.th/>>.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย The Stock Exchange of Thailand. <<http://www.set.or.th/>>.

ธนาคารแห่งประเทศไทย Bank of Thailand. <<http://www.bot.or.th/>>.

ศูนย์วิจัยกสิกรไทย Kasikornthai Research. <<http://www.kasikornresearch.com/kr/>>.

สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย. “ตลาดตราสารหนี้กับระบบเศรษฐกิจของประเทศ.” สำนักบริหารหนี้สาธารณะ. <<http://www.pdmo.mof.go.th/>>.

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์. <<http://www.sec.or.th/>>.

สำนักงานคณะกรรมการพัฒนาการเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ.
<<http://www.nesdb.go.th/>>.

สำนักงานเศรษฐกิจการค้า Bureau of Trade and Economic Indices.
<<http://www.price.moc.go.th/>>.

สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง. <<http://www.fpo.go.th/>>.

สำนักงานสถิติแห่งชาติ. <<http://www.nso.go.th/>>.

สัมภาษณ์

กนิษสม ตระการวิโรจน์. ผู้จัดการส่วนตราสารหนี้และเงินกู้ บริษัท ป.ต.ท. จำกัด (มหาชน).
สัมภาษณ์, 16 พฤศจิกายน 2549.

กรกสิวัฒน์ เกษมศรี. ผู้อำนวยการอาวุโส ฝ่ายจัดการลงทุนตราสารหนี้ กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ. สัมภาษณ์, 23 พฤศจิกายน 2549.

ณัฐดนัย ประทานพรทิพย์. ผู้ช่วยผู้จัดการกองทุน บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนฟินันซ่า จำกัด. สัมภาษณ์, 17 พฤศจิกายน 2549.

ดารณี แซ่จู้. ผู้บริหารทีม ทีมกลยุทธ์ ธนาคารแห่งประเทศไทย. สัมภาษณ์, 8 พฤศจิกายน 2549.

อนันต์ ศิวโมกธรรม. ผู้ช่วยผู้จัดการ ฝ่ายวิจัยและพัฒนา สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย. สัมภาษณ์, 13 พฤศจิกายน 2549.

สันติ กิระนันท์ และวัชรวรรณ พันธุ์วัฒนสกุล. ผู้อำนวยการและรองผู้อำนวยการตลาดตราสารหนี้ ตลาดตราสารหนี้ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. สัมภาษณ์, 15 พฤศจิกายน 2549.

อรรณพ อุดมพานิชย์. ผู้ช่วยผู้อำนวยการ ส่วนจัดการเงินลงทุน บริษัท กรุงเทพประกันชีวิต จำกัด. สัมภาษณ์, 15 พฤศจิกายน 2549.

Books

Cecco, M.D., Pecchi, L., and Piga, G. Managing Public Debt. Edward Elger, 1997.

Deacon, M., Derry, A., and Mirfendereski, D. Inflation-indexed Securities Bonds, Swaps & Other Derivatives. John Wiley & Sons Ltd (England), 2004.

Articles

Baffi, P., Indicizzazione, I., Cotula, F. and Stefani, P.D. "La Politica Monetaria in Italia." Bologna: Il Mulino (1979):691-699.

Barone, E. and Masera, R.S. "Index-linked Bonds from An Academic, Market and Policy-making Standpoint." Managing Public Debt: Index-linked Bonds in Theory and Practice Cheltenham, UK: Edward Elger (1997):117-147.

Barro, R.J. "A Suggestion for Revising the Inflation Adjustment of Payments on Index-linked Bonds." Mimeo, 24 August 1994.

Bootle, R. "Index-linked Gilts – A Practical Investment Guide." 2nd Edition. Hemel Hempstead, UK: Woodhead-Faulkner, 1991.

Burdekin, R.C.K., Denzau, A.T., Keil, M.W., Sitthiyot, T. and Willett, T.D. "When Does Inflation Hurt Economic Growth? Different Nonlinearities for Different Economies." Journal of Macroeconomics Vol. 26 (2004):519–532.

Campbell, J.Y. and Shiller, R.J. "A Scorecard for Indexed Government Debt." Harvard Institute of Economic Research Discussion Paper. No. 1758, May 1996.

Coronado, J. and Segreti, R. "Recent Trends and Policy Issues in the Demand for Inflation-indexed Instruments in Mature Markets." Published by Barclays Capital, Risk Awards 2006. Inflation Derivatives House of the Year, 2006.

Dijkstra, A.G. "Fighting Inflation in Latin America." Development and Change Vol. 28. (1997):531-557.

Economic Progress Report, "Indexed Gilts." Published by the Treasury, No. 133, May 1981.

Federal Register, Part IV, Department of the Treasury, Fiscal Service, 31 CFR Part 356, "Sale and Issue of Marketable Book-entry Treasury Bills, Notes, and Bonds-plain Language Uniform Offering Circular; Final Rule." (28 July 2004):45202-45224.

Fisher, I. "The Money Illusion." New York: Adelphi, 1928.

Fratzscher, O. and Valle, C.D. "Brazil's Domestic Debt Management Dilemma: Can Financial Indexation Dry the Ice?" The World Bank, November 2002.

Gong, F.F. and Remolona, E.M. "Inflation Risk in the US Yield Curve: The Usefulness of Indexed Bonds." Federal Reserve Bank of New York Research Paper. No. 9637, November 1996.

Hanke, S.H. and Walters, A. "Greenspan Bonds." Forbes, 12 September 1994.

Lindh, Y. and Ohlsson, K. "Indexobligationer-en Samhallsekonisk Analys." Sveriges Riksbank Working Paper. No. 5, April 1992.

Price, R. "The Rationale and Design of Inflation-indexed Bonds." International Monetary Fund Working Paper. No. 97/12, January 1997.

Prout, B., Rajendran, M., Salvadore, S. and Wyetzner, G. "Valuation Comparison of Inflation Indexed Bonds: Capital Indexed vs. Interest Indexed." Bankers Trust Inflation Linked Capital Markets Group Discussion Paper, 16 April 1997.

Radcliffe Committee, "Report of the Committee on Working of the Monetary System." the Radcliffe Report, August 1959.

Reddell, M. and Watt, B. "Some Perspectives on Inflation-indexed Bonds." Reserve Bank Bulletin Vol. 60 No. 5 (1997):323-331.

Research dialogue, "Understanding and Using Inflation Bonds." P. Brett Hammond, tiaa-crefinstitute.org, Issue No. 73, September 2002.

Shen, P. "Benefits and Limitations of Inflation Indexed Treasury Bonds." Federal Reserve Bank of Kansas City Economic Review, 3rd Quarter (1995):41-56.

Shen, P. and Corning, J. "Can TIPS Help Identify Long-term Inflation Expectations?" Federal Reserve Bank of Kansas City, Economic Review, 4th Quarter (2001):61-87.

Shiller, R.J. "The Invention of Inflation-indexed Bonds in Early America" Cowles Foundation Discussion Paper No.1442, Cowles Foundation for Research in Economics, Yale University, October 2003.

Sitthiyot, T. "Overstating Real Interest Rate." Economic Monitor Vol. 6 No. 9 (November – December 2001):43–49.

Spiro, P.S. "Real Interest Rates and Investment and Borrowing Strategy." Westport. CT: Quorum Books, 1989.

The Bond Market Association, New York, Washington, London "An Investor's Guide to U.S. Treasury Inflation-Protected Securities." 2004.

Townend, J. "Index-linked Government Securities: the UK Experience and Perspective." Managing Public Debt. Edward Elgar (1997):1-17.

United Kingdom Debt Management Office, "3M Lag Index-linked Gilts." 2005.

Gurminder Bhachu and Mark Deacon.

United Kingdom Debt Management Office, "Formulae for Calculating Gilt Prices from Yields." 3rd edition: 16 March 2005.

United Kingdom Debt Management Office, "Index-linked Gilt Re-design: Consultation Document." 12 March 2001.

United Kingdom Debt Management Office, "Index-linked Gilt Re-design: Consultation Document." 7 September 2001.

United Kingdom Debt Management Office, "Index-linked Gilt Re-design: Response to Consultation." 15 January 2002.

United Kingdom Debt Management Office, "Index-linked Gilt Switch Auctions: Response to Consultation." 10 May 2001.

United Kingdom Debt Management Office, "Issuance of Ultra-long Gilt Instruments Consultation Document." 2 December 2004.

United Kingdom Debt Management Office, "Issuance of Ultra-long Gilt Instruments Response to Consultation." 16 March 2005.

United Kingdom Debt Management Office, "Quarterly Review." April - June 2006.

US General Accounting Office "Consumer Price Index: Update of Boskin Commission's Estimate of Bias." (Report to the Ranking Minority Member, Committee on Finance US Senale, GAO/GGD-00-50, February 2000.

Weiner, S.E. "Why Are So Few Financial Assets Indexed to Inflation?" Federal Reserve Bank of Kansas City Economic Review (May 1983):3-18.

Wilson Committee. "Report of the Committee to Review the Functioning of Financial Institutions." The Wilson Report Chapter 5 and 17, 1980.

Wojnilower, A.M. "Inflation-indexed Bonds: Promising the Moon." New York: The Clipper Group, March 1997.

Wrase, J.M. "Inflation-indexed Bonds: How Do They Work?" Business Review Federal Reserve Bank of Philadelphia, July - August 1997.

World Wide Web (WWW)

Barclays Capital. "Barclays Inflation-linked Bond Indices".
<<https://ecommerce.barcap.com/gilbpub/docs/IndexGuide.pdf>>, January 2004.

Barclays Capital. <<http://www.barclayscapital.com/>>.

Bank of England. < <http://www.bankofengland.co.uk/index.htm>>.

Bank for International Settlements. <<http://www.bis.org/>>.

Bloomberg.com. <<http://www.bloomberg.com/>>.

Bond Electronic Exchange : BEX. <<http://www.bex.or.th/>>.

Bureau of the Public Debt. <<http://www.publicdebt.treas.gov/>>.

HM Treasury. <<http://www.hm-treasury.gov.uk/>>.

National Saving & Investment. <<http://www.nsandi.co.uk/>>.

National Statistics Online. <<http://www.statistics.gov.uk/default.asp>>.

Research Bank of New Zealand. < <http://www.rbnz.govt.nz/index.html>>.

Thaibond.com by ThaiBMA. <<http://www.thaibond.com/>>.

The Office Web Site of the U.S. Government Accountability Office.
<<http://www.gao.gov/>>.

The Thai Bond Market Association: ThaiBMA. <<http://www.thaibma.or.th/>>.

The World Bank. <<http://www.worldbank.org/>>.

Treasury Direct. <<http://www.treasurydirect.gov/>>.

United Kingdom Debt Management Office. <<http://www.dmo.gov.uk/>>.