

เอกสารอ้างอิง

- เกรียงไกร ไชยศิริวงศ์สุข. 2542. การศึกษาการประเมินมูลค่าตราสารสิทธิ โดยใช้ทฤษฎี **Black – Scholes Model** และ **Binomial Model**. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- กึ่งกาญจน์ วาฤทธิ. 2544. การประเมินราคาสิทธิอนุพันธ์ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จุฑามาศ สุพรจักร. 2552. การวิเคราะห์ความผันผวนของอัตราผลตอบแทนของดัชนีราคาหลักทรัพย์ล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ไทย สหรัฐอเมริกา ญี่ปุ่น และฮ่องกง. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ณรงค์ศักดิ์ วงศ์สิทธิกร. 2540. การวิเคราะห์ทางเศรษฐศาสตร์เกี่ยวกับการออก หุ้นสามัญ หุ้นกู้ หุ้นกู้ควอเตอร์แรนท์ และหุ้นกู้แปลงสภาพ. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ณวรา สกุล ณ มรรคา. 2540. ความสามารถในการพยากรณ์ของแบบจำลองการประเมินราคาควอเตอร์แรนท์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. สถาบันพัฒนาความรู้ตลาดทุน. 2551. รู้จัก **Index Options** สำหรับเจ้าหน้าที่การตลาดอนุพันธ์. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. สถาบันพัฒนาความรู้ตลาดทุน. 2550. ออปชั่น เรื่องของเวลา ราคา สิทธิ. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. สถาบันพัฒนาความรู้ตลาดทุน. 2550. **SET50 Index Options** เคล็ด(ไม่)ลับ ฉบับเขียน. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- บริษัท ตลาดอนุพันธ์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน). www.tfex.co.th
- ปฎุฒ ป่านทอง. 2548. การประเมินค่าความผันผวนของราคาหุ้นด้วยวิธีการชสำหรับการประเมินค่าราคาใบสำคัญแสดงสิทธิ โดยแบบจำลองแบล็คและโซลส์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ทิพวรรณ เลิศชูเกียรติ. 2552. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของสัญญาสินค้าเกษตรในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- มยุรี พรพฤติพันธ์. 2544. การประเมินราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ศุภสวัสดิ์ คัพภสาลี. 2553. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มประกันภัย และประกันชีวิตในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ศุชาติ ธนฉัตรพันธ์. 2548. การประเมินมูลค่าใบสำคัญแสดงสิทธิด้วยแบบจำลองแบล็คและโชลส์. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อานันท์ ลีมีคเดช. 2551. หลักการลงทุนและป้องกันความเสี่ยงด้วยตราสารอนุพันธ์ทางการเงิน. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. สถาบันพัฒนาความรู้ตลาดทุน.
- อัญชญา ไชยพุดม . 2550. การพยากรณ์ราคาทองคำในตลาดออสเตรเลียโดยวิธีอาร์มา. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Box, G ; Jenkin, G. and Reinsel , G. 1994. **Time Series Analysis**. Englewood Cliffs, NJ : Prentice – Hall.
- Dickey, D., & Fuller, W.A. 1979. “**Distribution of the Estimators for Autoregressive Time Series with a Unit Root.**” Journal of American Statistics Association 74 : 427 – 431
- Fischer, Donald E. and Jordan, Ronal J. 1995. **Security Analysis and Portfolio Management**. New York : McGraw – Hill.
- Engle, Robert E. and Grenger, Clive W.J. 1987. **Cointegration and Error Correction : Representation, and Testing**. Econometrica 55 (March) : 251 - 276
- Jack Johnston, John DiNardo. 1997. **Econometric methods**. New York : McGraw-Hill.
- John M. Keynes. 1964. **The General theory of employment, interest, and money**. New York : Harcourt, Brace & World.
- Jorion P. 2000. **Value at Risk: The New Benchmark for Managing Financial Risk**. Second Edition. The McGraw – Hill Companies Inc.
- Markowitz, Harry. 1952. **Portfolio Selection**. Journal of Finance.
- Milton Friedman ; with the assistance of Rose D. Friedman. 1962. **Capitalism and freedom**. University of Chicago.
- Walter Enders Hoboken. 2004. **Applied econometric time series**. N.J. : John Wiley.
- www.tfex.co.th . 2010. Statistical Highlight of Thailand Futures Exchange.