

บรรณานุกรม

หนังสือ

- เจริญ เจษฎาวัลย์. *การบริหารเงินบาทและเงินสกุลต่างประเทศ ภายใต้ระบบค่าเงินลอยตัว*
 กรุงเทพฯ : บริษัทพอดี้ จำกัด, พิมพ์ครั้งที่ 1 เมษายน 2541.
- เจริญ เจษฎาวัลย์. *ตราสารอนุพันธ์ เครื่องมือป้องกันความเสี่ยงทางการเงิน ตอนที่ 1*.
 กรุงเทพฯ : บริษัทพอดี้ จำกัด, พิมพ์ครั้งที่ 1 มีนาคม 2539.
- ทิพาภรณ์ ทวีกุลวัฒน์. *การซื้อขายสินค้าในตลาดล่วงหน้า*. กรุงเทพฯ : สำนักพิมพ์จุฬาลง-
 กรณ์มหาวิทยาลัย, พิมพ์ครั้งที่ 4 2539.
- ประเสริฐ คณาวัดมนไชย. *การวิเคราะห์ทางการเงิน โดยใช้ไมโครซอฟต์เอ็กเซล 95*.
 กรุงเทพฯ : สำนักพิมพ์แห่งจุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย, 2540.
- พิพัฒน์ พิทยาอัจฉริยกุล. *อนุพันธ์ทางการเงิน*. กรุงเทพฯ : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์,
 2538.
- เพชร ชุมทรัพย์. *หลักการลงทุน*. กรุงเทพฯ : สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, พิมพ์ครั้งที่
 11 (แก้ไขเพิ่มเติม) มิถุนายน 2540.
- อัณณา ชันฉวีไทย. *การวิเคราะห์การลงทุนในตราสารหนี้*. กรุงเทพฯ : สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัย
 ธรรมศาสตร์, พิมพ์ครั้งที่ 1 พ.ศ. 2541.
- Alan L. Tucker. *Financial Futures, Option & Swaps*. West Info Aces Distribution, 1992.
- Bernie Schaeffer. *The Option Advisor*. John Wiley & Sons Inc, 1997.
- Daigler T. Robert. *Financial Futures and Options Markets*. HarpetCollins College
 Publishers, 1994.
- Don M. Chance. *An Introduction to Derivatives third edition*. The Dryden Press Harcourt
 Brace College Publishers, 1995.
- Don M. Chance. *An Introduction to Options and Futures*. The Dryden Press Harcourt
 Brace College Publishers, 1989.
- Dubofsky, David A. *Options and Financial Futures : Valuation and Uses*.
 New York : Mc Graw-Hill Book Company, 1992.

- Espen Gaarder Haug . *The Complete Guide to Option Pricing Formula*. Mc Graw-Hill Hill Book Company,1997.
- Fred D. Arditti. *Derivatives*. Massachusetts : Harvard Business School Press Boston, 1996.
- Gibson,Rajna. *Option Valuation*. McGraw-Hill Inc. , 1991.
- Hull,John. *Options,Futures,and Other Derivatives*. 3rd ed. Prentice-Hall International Inc., 1997.
- John C. Cox. *Options Markets*. Mark Rubinstein Prentice, 1985.
- John C. Hull. *Introduction to futures and options markets*. Second ed. New Jersey : Prentice Hall, Englewood Cliff, 1995.
- Keith Redheal. *Introduction to financial futures and options*. Woodhead-Faulkner, 1990.
- Millard J. Brian. *Traded Options*. 2nd ed. John Willey & Sons, 1997.
- Nassim Taleb. *Dynamic Hedging*. John Wiley & Sons Inc., 1997.
- Neil A. Chriss. *The Black-Scholes and Beyond Interactive Toolkit*. IRWIN Professional Publishing, 1997.
- Neil A. Chriss. *Black-Scholes and Beyond : Option Pricing Models*. Irwin Professional Publishing, 1997.
- Richard M. *Bockstaber Probus Publishing Chicago*, 3 rd ed., 1991.
- Robert G. Tompkins. *Option Analysis*. Revised edition Probus Publishing, 1994.
- Robert W. Kolb. *Futures, Options & Swaps*. Blackwell Publishers, second edition, 1997.
- Russell R. Wasendorf ; Thomas A. Mc Cafferty. *All About Options*. Illinois : Probus Publishing Company Chicago, 1993.
- Stephen, Figlewski ; William L. Silber ; Marti G. Subrahmanyam. *Financial options*. New York University Salomon Centre, 1990.
- William Sutton. *The Currency options Handbook* (2nd ed) Woodhead – Fanekner , 1990.
- ดวงใจ วีสกุล ; มารศรี ผลาชีวะ ; สุภาพ เดชะรินทร์ และ สรชัย พิศาลบุตร. *สถิติธุรกิจ*. สำนักพิมพ์จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย พิมพ์ครั้งที่ 7, 2540.

วารสาร

- บริษัทหลักทรัพย์ เจ.เอฟ.ธนาคม จำกัด. *ทางเลือกใหม่ในการลงทุน ฝ่ายพาณิชย์*. พิมพ์ครั้งที่ 1 ศูนย์การพิมพ์อาคเนย์, กันยายน 37.
- ปกรณ์ วิทยานนท์. "เครื่องมือทางการเงินรุ่นใหม่และผลกระทบต่อนโยบายเศรษฐกิจ." *เอกสารงานวิจัยของมูลนิธิสถาบันเพื่อการพัฒนาประเทศไทย*, 2534.
- วรศักดิ์ ทุมมานนท์. "Adjust Black-Scholes Model". *จุฬาลงกรณ์ธุรกิจปริทัศน์* 17, 63 (มีนาคม 2538) : 25-29.
- สุกานดา ลูวิส. ตลาดซื้อขายล่วงหน้าทางการเงินในสหรัฐอเมริกา. *วารสารเศรษฐศาสตร์ธรรมศาสตร์* ปีที่ 16 ฉบับที่ 1 มีนาคม 2541.
- Black, F. "The Pricing of Commodity Contracts," *Journal of Financial Economics*, 3 (1976) : 167-179.
- Drezner, Z. "Computation of the Bivariate Normal Integral". *Mathematics of Computation* 32 (1987) ; 277– 279.
- GESKE, R. "the Valuation of Corporate Liabilities as Compound Options". *Journal of Financial and Quantitative Analysis*. New Jersey (1977) : 541-552.
- GESKE, R. "A Note on an Analytical Formula for Unprotected American Call Options on Stocks with Known Dividends". *Journal of Financial Economics*, 7, (1979a) : 63-81.
- GESKE, R. "The Valuation of compound Options". *Journal of Financial Economics*, 7 (1979b) : 63-81.
- JAMSHIDIAN, F. "An Exact Bond Option Formula". *Journal of Financial*, 44(1989) : 205-209.
- JAMSHIDIAN, F. "Sorting Out Swaptions". *Risk Magazine*, 9(3) (1996).
- JOHNSON , H. "Options on the Maximum or the Minimum of Several Assets". *Journal of Financial and Quantitative Analysis*, 22(3) (1987) : 277-283.
- MERTON,R.C. "Theory of Rational Option Pricing". *Bell Journal of Economics and Management Science* 4, (1973) : 141-183.
- MERTON, R.C. "Option Pricing When Underlying Stock Returns are Discontinuous". *Journal of Financial Economics*., 3, (1976) : 125-144.

- R. C. Merton. "Theory of Rational Option Pricing". *Bell Journal of Economics and Management Science* 4 (Spring 1973) : 141-183.
- ROLL R. "An Analytic Valuation Formula for Unprotected American Call Options on Stocks with Known Dividends". *Journal of Financial Economics*, 5, (1977) : 251-58.
- Whaley, R. E. "On the valuation of American Call Options on Stocks with Known Dividends". *Journal of Financial Economics*, 9, (1981) : 207-211.
- Barone Adesi, G and R. E. Whaley "Efficient Analytic Approximation of American Option Values". *Journal of Finance*, 42(2), (1987) : 301-320.
- F.Black and M. Scholes. "The Pricing of Options and Corporate Liabilities". *Journal of Political Economy* 81 (May-June 1973) : 637-654.
- Black, F.,E. Derman, and W. Toy "A One-Factor Model of Interest Rates and Its Application to Treasury bond Options". *Financial Analysts Journal*, (1990) : 33-39.
- Cox, J. ,S. Ross , and M. Rubinstein. "Option Pricing : A Simplified Approach". *Journal of Financial Economics* 7 (October 1979) : 229-264.
- Garman, Mark B., and Teven W. Kohlhagen. "Foreign Currency Options Values" *Journal of International Money and Finance*. Vol.2, December (1983) : 231- 237.
- RENDELMAN,R.J., and BARTTER "Two-State Option Pricing". *Journal of Finance*, 34, (1979) : 1093-1110.

วิทยานิพนธ์

- วรินทร์ธร เพชรแท้. *การประเมินมูลค่าสิทธิในการขายเงินตราต่างประเทศในประเทศไทย*. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.
- ยงยุทธ์ เสฎฐวิวรรณ. *การประยุกต์ใช้ USD/THB Currency Option Pricing ตามแนวคิด Black and Scholes Model ช่วงปี พ.ศ. 2538- 2540*. วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์, 2541.