

บรรณานุกรม

- คมสันต์ ปิยะมาลัยมาส. 2545. **มูลค่าเสี่ยงสำหรับตลาดหลักทรัพย์ภูมิภาคเอเชีย**. วิทยานิพนธ์
วิทยาศาสตร์มหาบัณฑิตสถาบัน จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- จิรัตน์ ตั้งขี้แก้ว. 2547. **การลงทุน**. กรุงเทพมหานคร: โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- ชาญณรงค์ ชัยพัฒน์. 2550. “ตราสารอนุพันธ์ และ SET 50 Index Futures”. [ระบบออนไลน์].
แหล่งที่มา <http://www.fizones.com> (14 กันยายน 2550)
- ชานนท์ ชิงชยานุรักษ์. 2551. “Quantitative analysis in finance 702341”. [ระบบออนไลน์].
แหล่งที่มา <http://www.ba.cmu.ac.th> (10 กันยายน 2551)
- ฐนิตพงศ์ ชื่นภิบาล. 2550. “ความเสี่ยงจากการลงทุน”. [ระบบออนไลน์]. แหล่งที่มา
<http://www.manager.co.th> (14 มิถุนายน 2550)
- ถวิล นิลใบ. 2546. **The Capital asset pricing model CAPM เอกสารประกอบการบรรยายวิชา
Financial Management**. คณะบริหารธุรกิจมหาวิทยาลัยรามคำแหง.
- คูสิต โคมทอง. 2550. “การวัดความเสี่ยงด้านตลาดของตราสารหนี้”. [ระบบออนไลน์].
แหล่งที่มา: <http://www.irisk.thaibma.or.th> (31 กรกฎาคม 2550)
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2550. “กลุ่มหลักทรัพย์ตามดัชนี SET 50 คืออะไร”. [ระบบ
ออนไลน์]. แหล่งที่มา <http://www.set.or.th> (13 กรกฎาคม 2550)
- บริษัทหลักทรัพย์ เอบีเอ็น แอมโร เอเชีย จำกัด (มหาชน). 2542. “Value at Risk ในแง่มุมมองของ
Broker”. [ระบบออนไลน์]. แหล่งที่มา <http://inv4.asiaplus.co.th> (20 มิถุนายน 2550)
- ยุทธนา เรืองสุภา. 2543. **การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ กลุ่มธนาคาร
พาณิชย์ ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วดี ทับทิมทอง. 2537. **การวิเคราะห์อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงจากการลงทุนหลักทรัพย์ใน
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิตสถาบัน
เทคโนโลยีสังคม (เกริก).
- เสถียร จันทน์แสงศรี. 2540. **มูลค่าความเสี่ยงสำหรับพันธบัตรและเงินกู้ต่างประเทศ ของรัฐบาล
ไทย**. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์และการเงินระหว่างประเทศมหาบัณฑิตสถาบัน
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

- เสาวณีย์ นัทรไพศาลสุข. 2543. การวัดความเสี่ยงของการขาดทุนจากการลงทุนหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้เทคนิค Value at risk. การศึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- อัญญา ชันชวิทย์. 2547. การวิเคราะห์ความเสี่ยงจากการลงทุนในหลักทรัพย์. กรุงเทพมหานคร: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- อานัติ ลิ้มคเดช. 2546. “การสร้างพอร์ตหุ้นด้วยวิธีคำนวณเชิงพันธุกรรม”. วารสารบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์. 99(กรกฎาคม 2546): 1-12.
- Dimitris, Chorafas N. 1997. The MARKETING RISK AMENDMENT. **Understanding the market-to-Model and Value-at-Risk**. New York: McGraw-Hill.
- Hull, J. and Alan, W. 1997. “Value-at-Risk When Daily Changes in Market Variables Are Not Normally Distributed”. **Journal of Derivatives 5**: 9-19
- Kupiec, P. 1995. “Techniques for Verifying the Accuracy of Risk Management Models”. **Journal of Derivatives 3**: 73-84
- Markowitz, Harry M. 1952. “Portfolio Selection”. **Journal of finance 7**(March): 77-91