

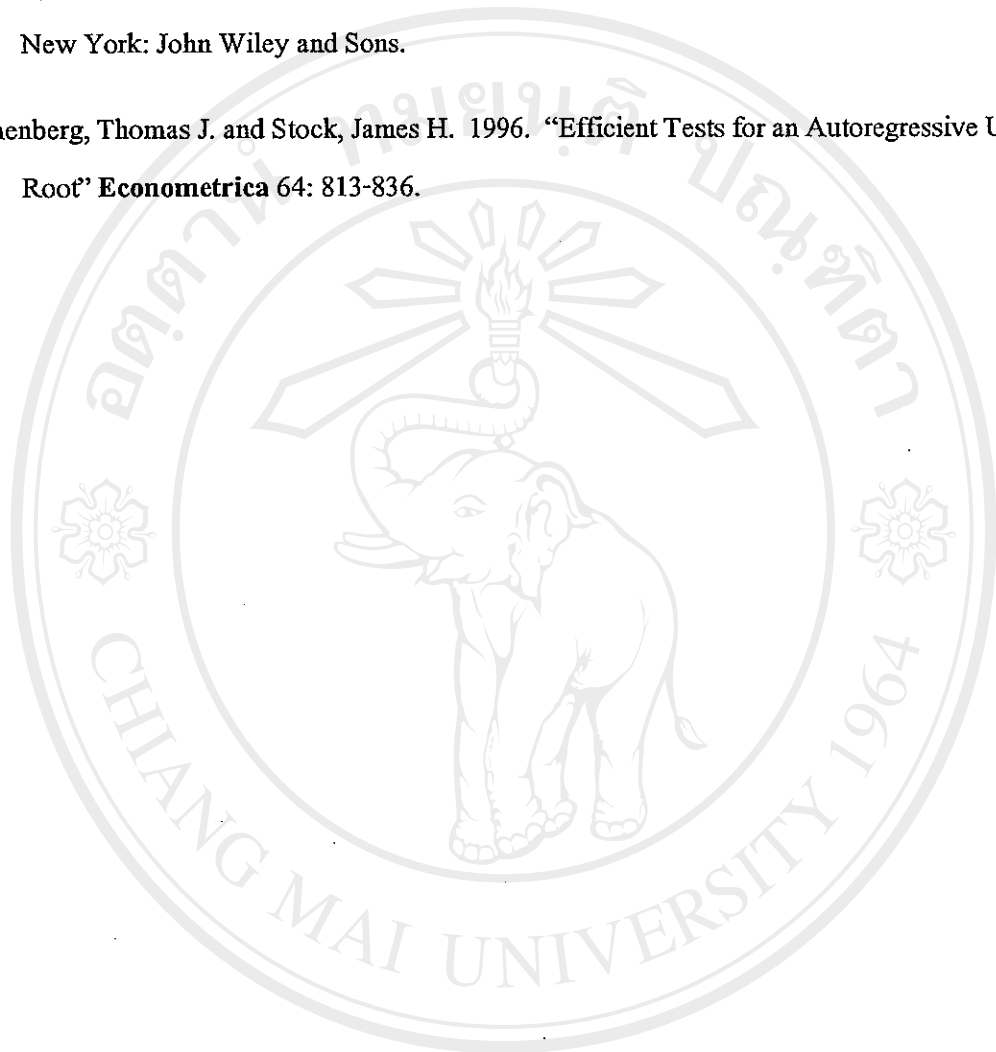
เอกสารอ้างอิง

- อัคราภรณ์ อินทอ่อนวงศ์. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นอาหารและเครื่องดื่มบางหุ้นโดยวิธีการถดถอยสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อัญญา ชันชวิทย์. 2547. การวิเคราะห์ความเสี่ยงจากการลงทุนในหลักทรัพย์. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- Black, F. and Scholes, M. 1973. "The pricing of options and corporate liabilities" *Journal of Political Economy* 81: 637-654.
- Bouchaud, Jean-Philippe and Potters, Marc. 2003. *Theory of financial risk and derivative pricing : from statistical physics to risk management*. Cambridge: Cambridge University Press.
- Butler, Cormac. 1999. *Mastering Value at risk : a step-by-step guide to understanding and applying Var*. London: Financial Times/Prentice Hall.
- Conrad, James R. *Analysing the Risks of Information Security Investment with Monte-Carlo Simulations*. Available: <http://infoecon.net/workshop/pdf/13.pdf> (14 March 2007)
- Cvitanic, Jaks; Goukasian, Levon and Zapatero, Fernando. 2000. *Hedging with Monte Carlo Simulation*. Available: <http://citeseer.ist.psu.edu/cache/papers/cs/16695/http%3A%2FzSzzSzmath.usc.edu%2FcvitaniczSzzapatoptions1.pdf/cvitanic00hedging.pdf> (14 March 2007)
- Glasserman, Paul; Heidelberger, Philip and Shahabuddin, Perwez. 2000. *Efficient Monte Carlo Methods for Value-at-risk*. Available: www.gsb.columbia.edu/faculty/pglasserman/Other/masteringrisk.pdf (14 March 2007)
- Hull, J. 2000. *Options, Futures, & Other Derivatives*. 4thed. New Jersey: Prentice Hall.

Jorion, Philippe. 2002. **Value At Risk**. 2nded. New York: McGraw-Hill.

Pearson, Neil D. 2002. **Risk budgeting : Portfolio Problem Solving with Value-at-Risk**.
New York: John Wiley and Sons.

Rothenberg, Thomas J. and Stock, James H. 1996. "Efficient Tests for an Autoregressive Unit
Root" **Econometrica** 64: 813-836.



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved