

เอกสารอ้างอิง

- กันตพร ช่วงชิด. 2555. การประยุกต์เศรษฐมิติแบบสุดโต่งในการวิเคราะห์ราคาพืชพลังงาน. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรดุษฎีบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เจนเนตร มณีนาถ, กรกนก วงศ์พานิช, ปัญจมน แก้วมีแสง และ ดร.ณรัตน์ พึ่งตน. 2548. การบริหารจัดการความเสี่ยงระดับองค์กร: จากหลักผู้บริหารสู่ภาคปฏิบัติ (Enterprise-wide risk management). กรุงเทพฯ: บริษัท ไลน์ ออล การพิมพ์.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2014. SET Index Highlight Monthly Report April 2014. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th.htm>. (24 เมษายน 2557)
- นาราลิน วงศ์เรือง. 2553. การจำลองแบบการประเมินราคาสินทรัพย์ประเภทหุ้นที่ผันแปรไปตามกาลเวลา กรณีศึกษากลุ่มธนาคารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- บุพพรรณ วุฒิชัยวงศ์. 2551. การทดสอบความสัมพันธ์ระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนกับราคาหลักทรัพย์ของกลุ่มธนาคารในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ปัญญาพร ศรีชนาพันธ์. 2547. การบริหารความเสี่ยงของกลุ่มธุรกิจอสังหาริมทรัพย์ในเขตอำเภอเมือง จังหวัดเชียงใหม่. การค้นคว้าแบบอิสระ บัณฑิต มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- พัชชาจูน อนันตธรรมและ สุมิตราตั้งสมวรวงษ์. 2555. หุ่นปั้นผล: ขุมทรัพย์ของการลงทุน. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th/setresearch.htm>. (22 เมษายน 2557)
- ยุวดี คันทะมูล. 2548. การวิเคราะห์ความสัมพันธ์ระหว่างราคาและปริมาณของหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยวิธี โคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

- ศิริยศ จุฑานนท์. 2555. แนวทางการสร้างความสมดุลของโครงสร้างบริษัทจดทะเบียนในตลาดหุ้นไทย. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th/setresearch.htm>. (22 เมษายน 2557)
- ศิริลักษณ์ เล็กสมบูรณ์. 2531. การวิเคราะห์หอนุกรมเวลา. ตำราประกอบการเรียนวิชาอนุกรมเวลาและเลขดัชนีคณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ.
- สาธิต พรหมมินทร์. 2555. การวิเคราะห์มูลค่าความเสี่ยงและค่าเฉลี่ยความเสียหาย ส่วนเกินของผลตอบแทนดัชนีหลักทรัพย์มอร์แกนสแตนลีย์อินเตอร์เนชันแนลโดยใช้ทฤษฎีมูลค่าปลายสุด: ตลาดเกิดใหม่เอเชีย วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สุชาติ ศิริวัฒน์ และ เหมือนขวัญ รอดเดช เศรษฐกร. 2556. สถานการณ์การออมและการลงทุน และการพัฒนาตลาดทุนไทย :แนวโน้มปี 2556. แหล่งที่มา: <http://www.fpo.go.th/S-I/Source/Article/Article145.pdf>. (18 เมษายน 2557)
- Chaithep Kittiya. 2012. **Value at Risk Analysis of Gold Price Returns Using Extreme Value Theory**. Master of Economics Chiang Mai University.
- Coles, S. G. 2001. **An introduction to statistical modeling of extreme values**. In Springer-Verlag London Limited, from <http://dx.doi.org/10.1111/j.0006-341x.2002.01038.x>
- Rakonczai, P., & Tajvidi, N. 2010. **On Prediction of Bivariate Extreme**. International Journal of Intelligent Technologies and Applied Statistics, 3(2), 115-139.
- Tawn, J. A. 1988. **Bivariate extreme value theory: models and estimation**. Biometrika, 75, 397–415
- Thailand Securities Institute. 2012. **เส้นทางการลงทุน**. แหล่งที่มา: http://www.tsithailand.org/index.php?option=com_content&task=view&id=94&Itemid=67. (17 พฤษภาคม 2555)