

เอกสารอ้างอิง

- สุรินทร์ ขนานศักดิ์ และคณะ. 2541. สถิติเบื้องต้น. พิมพ์ครั้งที่ 1: เชียงใหม่ หน่วยพิมพ์เอกสาร คณะ
วิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
- ศุภชัย ศรีสุชาติ. 2546. “การวัดค่า VaR ด้วยสมมติฐานตัวแบบ Student’s t”. วารสารบริหารธุรกิจ.
ปีที่ 26 ฉบับที่ 99 (กรกฎาคม– กันยายน 2546): 22-35. กรุงเทพฯ: มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
อานัติ ลิ้มคเดช. 2550. “ผลกระทบต่อราคาหุ้นที่ถูกรวมและตัดออกจากกลุ่มหลักทรัพย์ในดัชนี
SET50” วารสารบริหารธุรกิจ .ปีที่30 ฉบับที่ 116 (ต.ค.-ธ.ค. 2550) 9-24 . กรุงเทพฯ:
มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
- อัญญา ชันชวิทย์. 2546. พฤติกรรมความเสี่ยงของหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. รายงานวิจัยเสริม
หลักสูตร พ.ศ. 2545. มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- อัญญา ชันชวิทย์. 2547. การวิเคราะห์ความเสี่ยงจากการลงทุนในหลักทรัพย์. พิมพ์ครั้งที่ 1.
กรุงเทพฯ: อมรินทร์พริ้นติ้งแอนด์พับลิชชิ่ง.
- Bank for International Settlement. 1996. **Supervisory framework for the use of “backtesting”
in conjunction with the internal models approach to market risk capital
requirement**, Bank for International Settlements, Basle.
- Jondeau, E., and Rockinger, M., 2003. “Testing for differences in the tails of stock-market
returns”. **Journal of Empirical Finance** 10, 559 – 581
- Jorion, P., 2007. **Financial Risk Manager Handbook**. 4th ed. John Wiley and Son, New Jersey.
- Keratithamkul, C., 2005. **The Effect on Stock Price of Inclusion or Exclusion from the SET
50**. Master In finance thesis, Thammasat University.
- Kevin, D., 1998. **Beyond Value at Risk: The New Science of Risk Management**, John Wiley
and Son, New York.
- Inui, K., Kijima, M., and Kitano, A., 2005. VaR is subject to a significant positive bias,
Statistics & Probability Letters 72, 299–311.
- Kupiec, P., 1998. Stress testing in a value at risk framework, **Journal of Derivatives**. 6: 7-24.
- Wang, S., Mun Ho, C., and Dollery, B., 2003. **An Analysis of Stress Testing for Asian Stock
Portfolios**, Working Paper, University of New England School of Economics, Australia