

เอกสารอ้างอิง

กิตติพันธ์ คงสวัสดิ์เกียรติ. (2551). การจัดการความเสี่ยงและตราสารอนุพันธ์เบื้องต้น. กรุงเทพฯ: เพียร์สัน เอ็ดดูเคชั่น.

ขวัญฤทัย วชิรพันธ์สถิต. (2550). การวิเคราะห์ความเสี่ยงและอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มดัชนี SET 50. การค้นคว้าแบบอิสระ. มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

จิราธิป ชนะชัย. (2553). การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหุ้นกลุ่มพลังงานโดยวิธีควอนไทล์รีเกรสชัน. การค้นคว้าแบบอิสระ. มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์กุล. (2553). แบบจำลองการตั้งหลักทรัพย์โดยวิธีการถดถอบแบบควอนไทล์สำหรับ SET 50. เชียงใหม่: มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ธรรมรัตน์ เกลิมพลประภา. (2551). มูลค่าความเสี่ยงของการลงทุนในกลุ่มหลักทรัพย์หุ้นสามัญตามดัชนี SET 50 ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ. มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ปรีทัศน์ เหลืองอุทัย. (2548). คู่มือตราสารอนุพันธ์ฟิวเจอร์สดัชนี SET 50. กรุงเทพฯ: บีแอนด์แอล แมเนจเม้นท์

ปรีชา มหารันต์. (2554). การสร้างแบบจำลองราคาทองคำแห่งประเทศไทยโดยใช้วิธีควอนไทล์รีเกรสชัน แบบมีเงื่อนไข. การค้นคว้าแบบอิสระ. มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

พรทิพย์ เขียวธีรวิทย์. (2555). การเงินการธนาคาร. เชียงใหม่: มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

พันทิสภา ภาวบุตร. (2553). ร่าง บทที่ 6 สัญญาซื้อขายล่วงหน้า SET 50 Index Futures เพื่อการบริหารความเสี่ยง การค้าและการลงทุน. ในหนังสือ 75 ปี ธรรมศาสตร์ 35 ปี เอ็มเอฟซี : ประเด็นศึกษาด้านวิศวกรรมการเงินในตลาดการเงินไทย.

อนุสร ต่ายหัวดวง. (2551). การประมาณค่าความผันผวนสำหรับผลตอบแทนของดัชนีกลุ่ม 50 หลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยใช้แบบจำลองอาร์มา-การ์ช .การค้นคว้าแบบอิสระ. มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ .

อานันต์ ลิ้มคเคช. (2551). หลักการลงทุนและป้องกันความเสี่ยงด้วยตราสารอนุพันธ์ทางการเงิน . กรุงเทพฯ: อมรินทร์พริ้นติ้งแอนด์พับลิชชิ่ง

Colin (Lin) Chen. 2005. "An Introduction to Quantile Regression and the QUANTREG Procedure." Statistics and Analysis 213-30

Conroy, Robert M. 2003. **Hedging with Forwards and Futures**. The University of Virginia Darden School Foundation,

Dickey, D.A. and Fuller, W.A. 1981. "Likelihood ratio statistic for autoregressive time series with unit root". **Econometrica** 49. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์**. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

Gujarati, Domonar N. 1995. **Basic Econometrics**. 3rded. New York: McGraw Hill. อ้างถึงใน ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2547. **เศรษฐมิติ: ทฤษฎีและการประยุกต์**. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

Pelletier, Denis. 2006. **Hedging Using Futures**. North Carolina State University.