

## เอกสารอ้างอิง

จิรัตน์ สัจจ์แก้ว. (2547). การลงทุน. กรุงเทพมหานคร : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.  
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. พัฒนาการตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย 36 ปี พ.ศ. 2518 –  
2554.ระบบออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก :

[http://www.set.or.th/setresearch/files/F\\_graph\\_36years\\_SET.pdf](http://www.set.or.th/setresearch/files/F_graph_36years_SET.pdf). (วันที่ค้นข้อมูล : 20  
พฤษภาคม 2555).

ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. (2547). เศรษฐมิตติ: ทฤษฎีและการประยุกต์. เชียงใหม่ : คณะเศรษฐศาสตร์  
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

ประภพ ปฎิภาณวิเศษ. (2550). ผลตอบแทนและความเสี่ยงของกองทุนรวมหุ้นระยะยาว.  
วิทยานิพนธ์ปริญญาโทบริหารธุรกิจ, สาขาเศรษฐศาสตร์ธุรกิจ คณะเศรษฐศาสตร์  
มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์

พรอนงค์ บุษราตระกูล. (2547). การลงทุนพื้นฐานและการประยุกต์. กรุงเทพมหานคร : โรงพิมพ์  
แห่งจุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

พิเชษฐ โพธิ์จรยากุล. (2545). ศึกษาความเสี่ยงและผลตอบแทนของกองทุนรวมในประเทศไทย.  
การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

มนตร์รัตน์ โพธิ์วีจิตร. (2539). การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนจากการลงทุนกองทุนใน  
ประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์. สถิติกองทุนรวม. [ระบบ  
ออนไลน์]. เข้าถึงได้จาก :

[http://www.sec.or.th/sec/Content\\_0000000103.jsp?categoryID=CAT0000021&lang=th](http://www.sec.or.th/sec/Content_0000000103.jsp?categoryID=CAT0000021&lang=th).  
(วันที่ค้นข้อมูล : 25 พฤษภาคม 2555).

เสาวนีย์ ฉัตรไพศาลสุข (2543). การวัดความเสี่ยงของการขาดทุนจากการลงทุนหลักทรัพย์ภายใน  
หลักทรัพย์ภายในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. การศึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ  
เศรษฐศาสตร์มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.

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