

รายการอ้างอิง

ภาษาไทย

มานพ วรศักดิ์. 2547. การจำลองเบื้องต้น: Introduction to Simulation. กรุงเทพมหานคร: ศูนย์ผลิตตำราเรียนสถาบันเทคโนโลยีพระจอมเกล้าพระนครเหนือ.

มานพ วรศักดิ์. 2548. ทฤษฎีความน่าจะเป็น. พิมพ์ครั้งที่ 1. กรุงเทพมหานคร: สำนักพิมพ์แห่งจุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

ภาษาอังกฤษ

Hull, J. and White, A. 2004. Valuation of a CDO and an n-th to Default CDS Without Monte Carlo Simulation. The Journal of Derivatives, 12, 2, 8-23.

Hull, J. and White, A. 2005. "The Perfect Copula," University of Toronto, paper draft November 2005.

Embrechts, P., McNeil, A., and Strauman, D. 1999. "Correlation and dependence in risk management: properties and pitfalls," paper draft July 1999.

Embrechts, P., Lindskog, F., and McNeil, A. 2001. "Modelling Dependence with Copulas and applications to Risk Management", paper draft September 2001.

ประวัติผู้เขียนวิทยานิพนธ์

นางสาวพรรณทิพา วาณิชย์จิรัฐติกาล เกิดเมื่อวันที่ 8 กุมภาพันธ์ พ.ศ.2524 ที่กรุงเทพมหานคร สำเร็จการศึกษาปริญญาวิทยาศาสตรบัณฑิต (วท.บ.) ภาควิชาคณิตศาสตร์ คณะวิทยาศาสตร์ มหาวิทยาลัยเทคโนโลยีพระจอมเกล้าธนบุรี ในปีการศึกษา 2544 และเข้าศึกษาต่อในหลักสูตรสถิติศาสตรมหาบัณฑิต ภาควิชาสถิติ คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย เมื่อปีการศึกษา 2546

