

เอกสารอ้างอิง

กึ่งกาณจน์ วาฤทธิ. การประเมินราคาสิทธิอนุพันธ์ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์. การค้นคว้าแบบอิสระ
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2544.

เกรียงไกร ไชยศิริวงศ์สุข. การศึกษาการประเมินมูลค่าตราสารสิทธิ โดยใช้ทฤษฎี Black-Scholes
Model และ Binomial Model. การค้นคว้าแบบอิสระบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2542.

จิรัตน์ สังข์แก้ว. หลักการลงทุน. พิมพ์ครั้งที่ 4 กรุงเทพฯ : โรงพิมพ์มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์,
2544.

ฉวรา สกุล ณ มรรคา. ความสามารถในการพยากรณ์ของแบบจำลองการประเมินราคาออร์เรนที่
วิทยานิพนธ์ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540.

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2547. **Investment Info.** แหล่งที่มา

http://www.set.or.th/static/market/market_u13.html 15 ธันวาคม 2547.

ทัศนัย วนรัตน์วิจิตร. การประเมินราคาใบสำคัญแสดงสิทธิ. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตร
มหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2538

ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2547. **Historical Reference Yield Spreads.** แหล่งที่มา

http://www.bot.or.th/bothomepage/databank/FinMarkets/Bond/T_State_menu.htm

15 ธันวาคม 2547.

สันติ ธิรพัฒน์. พฤติกรรมของราคาออร์เรนที่ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วารสาร

เศรษฐศาสตร์จุฬาลงกรณ์ 2536 ; 5(1) : 3-33

มยุรี พรพฤติพันธุ์. การประเมินราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์. การค้นคว้าแบบอิสระ

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่, 2540

Lauterbach, B., and Schultz, P. "Warrant : An Empirical Study of Black & Scholes Model." **The
Journal of Finance** 45, 4(1990) : 1181-1209

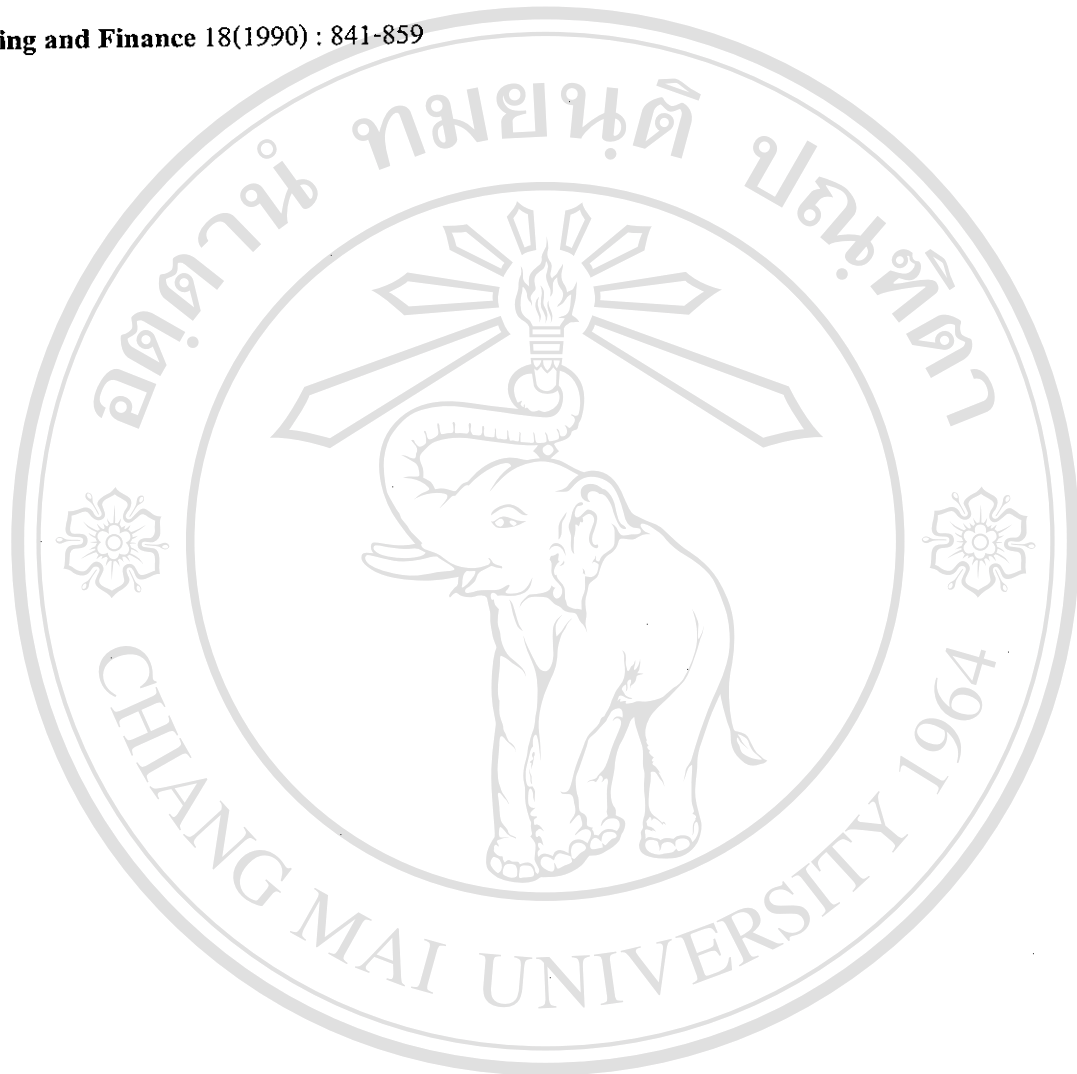
Black, F., and Scholes, M. "The pricing of Option and Coporate Liability." **Journal of Political
Economics** (May/June) 1973 :637-654

Wilmott, Pual ; Howison, Sam and Dewynne, Jeff. **The Mathematics of Finance Derivatives :**

A Student Introduction. New York : McGraw-Hill, 1998.

Schultz, G.U., and Trautmann, S. "Robustness of Option like Warrant Valuation Value." **Journal**

of Banking and Finance 18(1990) : 841-859



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved