

การประเมินราคาสิทธิอนุพันธ์ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์

กิงกาญจน์ วาฤทธิ

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
กันยายน 2544

การประเมินราคาสิทธิอนุพันธ์ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์

กิ่งกาญจน์ วาฤทธิ์

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

..... ประธานกรรมการ

อาจารย์ เอนก นิยมรัตน์

..... กรรมการ

อาจารย์ ดร. ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์

..... กรรมการ

ผู้ช่วยศาสตราจารย์ สุรภร วิศิษฐ์สุวรรณ

21 กันยายน 2544

ลิขสิทธิ์ของบัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สำเร็จลงได้ด้วยความกรุณาจาก อาจารย์ เอนก นิยมรัตน์ ประธานกรรมการที่ปรึกษา อาจารย์ ดร. ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และผู้ช่วยศาสตราจารย์ สุรกร วิศิษฎ์สุวรรณ กรรมการที่ปรึกษา ที่ได้กรุณาให้คำแนะนำ คำปรึกษา ข้อคิดเห็น และแนวทางที่เป็นประโยชน์อย่างยิ่ง ตลอดจนตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องต่าง ๆ ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงมา ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณคณาจารย์ทุกท่านที่ได้ถ่ายทอดความรู้ เพื่อเป็นรากฐานการศึกษาให้กับผู้เขียน

ขอขอบคุณเจ้าหน้าที่ ธนาคารแห่งประเทศไทย บริษัทหลักทรัพย์ แอ็ดคินซัน จำกัด (มหาชน) บริษัทหลักทรัพย์ กิมเอ็ง (ประเทศไทย) จำกัด เจ้าหน้าที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เจ้าหน้าที่คณะเศรษฐศาสตร์ และเจ้าหน้าที่ห้องสมุดคณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ ที่กรุณาเอื้อเฟื้อข้อมูลที่ใช้ในการศึกษาในครั้งนี้เป็นอย่างดี

ขอขอบคุณเพื่อนร่วมงาน และเพื่อนร่วมรุ่นที่ได้ให้คำแนะนำ ตลอดจนให้กำลังใจด้วยดีตลอดมา โดยเฉพาะอย่างยิ่ง คุณแม่ ที่ได้อบรมเลี้ยงดู ส่งเสริมและให้กำลังใจด้วยดีตลอดมา

ท้ายที่สุดนี้ หากมีสิ่งขาดตกบกพร่องหรือผิดพลาดประการใด ผู้เขียนขออภัยเป็นอย่างสูงในข้อบกพร่องและความผิดพลาดนั้นและผู้เขียนหวังว่าวิทยานิพนธ์นี้คงมีประโยชน์บ้าง ไม่นมากก็น้อยสำหรับหน่วยงานที่เกี่ยวข้องตลอดจนผู้ที่สนใจที่จะศึกษารายละเอียดเกี่ยวกับ Set 50 Options ต่อไป

กิงกาญจน์ วาฤทธิ