

การประมาณค่าความผันผวนของราคาหุ้นด้วยวิธีการสำหรับการประเมินค่า
ราคาใบสำคัญแสดงสิทธิ โดยแบบจำลองแบล็คและโชลส์



ปภูล ป่านทอง

เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright © by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย

มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

พฤษภาคม 2548

การประมาณค่าความผันผวนของราคาหุ้นด้วยวิธีการสำหรับการประเมินค่า
ราคาใบสำคัญแสดงสิทธิ โดยแบบจำลองแบล็คและโชลส์

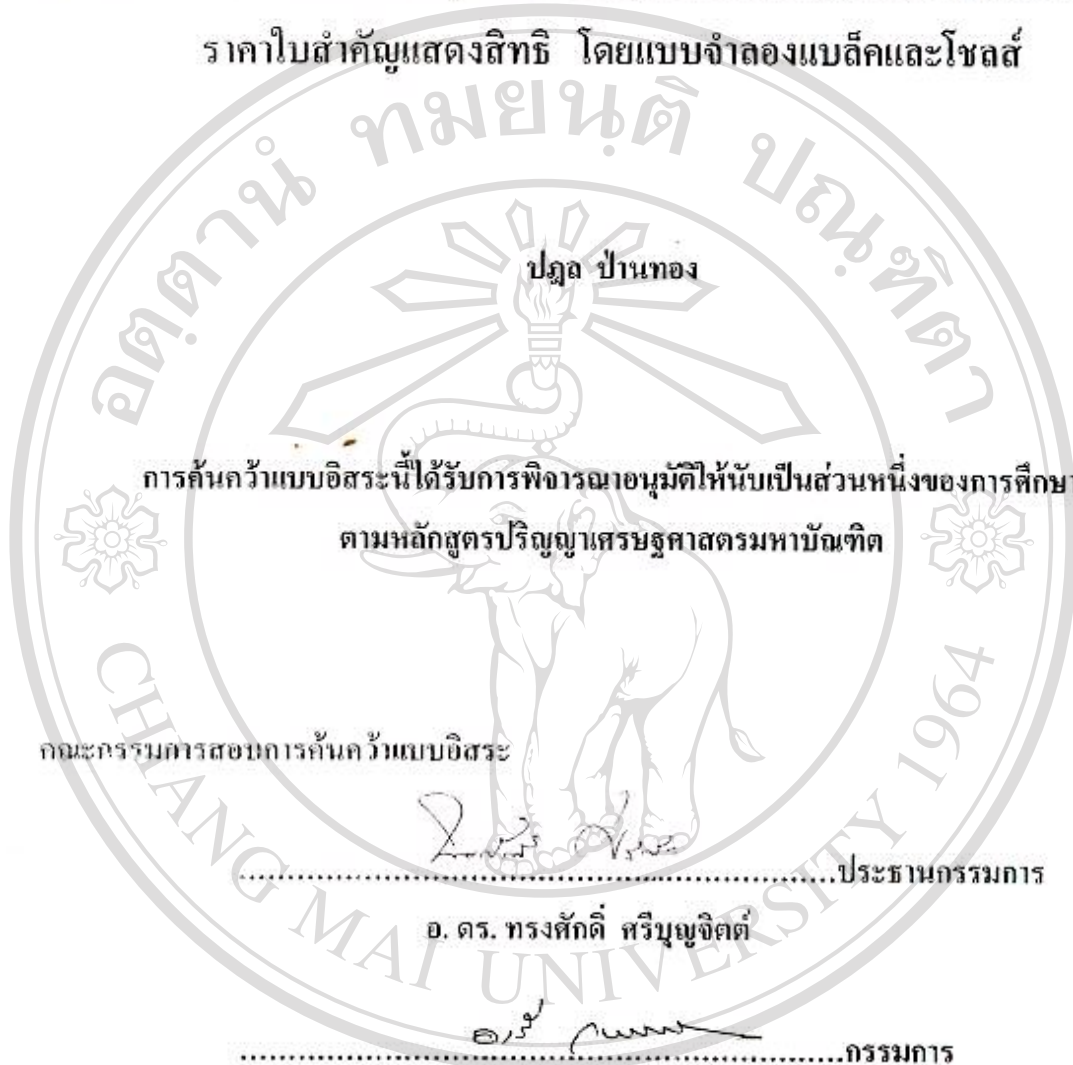
ปภูด ป่านทอง

การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
พฤษภาคม 254

การประมาณค่าความผันผวนของราคาหุ้นด้วยวิธีการสำหรับการประเมินค่า
ราคาใบสำคัญแสดงสิทธิ โดยแบบจำลองแบล็คและโชลส์



ปดูล ปานทอง

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระ

.....ประธานกรรมการ
อ. ดร. ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์

.....กรรมการ
รศ. ดร.อารี วิบูลย์พงศ์

.....กรรมการ
อ. ดร. ไพรัช กาญจนการุณ

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved

12 พฤษภาคม 2548

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

ผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณ อาจารย์ ดร. ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ อาจารย์ที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระเป็นอย่างสูง ที่กรุณาให้ความรู้ คำแนะนำ คำปรึกษา และตรวจแก้ไขงานการค้นคว้าแบบอิสระนี้เสร็จสมบูรณ์

ขอกราบขอบพระคุณ รองศาสตราจารย์ ดร.อารี วิบูลย์พงษ์ และอาจารย์ ดร.ไพรัช กาญจนการุณ ที่กรุณารับเป็นกรรมการตรวจสอบการค้นคว้าแบบอิสระ และให้คำแนะนำเป็นอย่างดีตลอดจนตรวจแก้ไขการค้นคว้าแบบอิสระนี้ให้สมบูรณ์ยิ่งขึ้น

ขอขอบพระคุณ อาจารย์ผไทรัตน์ ภาสกรพิพัฒน์กุล อาจารย์ชัยวัฒน์ และอาจารย์กัญสุดา นิ่มอนุสรณ์กุล ที่กรุณาให้ความรู้และคำแนะนำต่างๆ ในการเรียนและการใช้โปรแกรมคอมพิวเตอร์ รวมทั้งเจ้าหน้าที่ศูนย์การเงินและการลงทุนที่ให้ความช่วยเหลือในการค้นหาข้อมูล คุณพ่อ และน้องสาว ที่ให้ความช่วยเหลือและกำลังใจมาโดยตลอด

ท้ายที่สุดนี้ หากมีสิ่งใดขาดตกบกพร่องหรือผิดพลาดประการใด ผู้เขียนขออภัยเป็นอย่างสูงในข้อบกพร่องและผิดพลาดนั้น และหวังว่าการค้นคว้าแบบอิสระนี้คงมีประโยชน์บ้างไม่มากนักน้อยสำหรับนักลงทุนและผู้สนใจ

ปฐกุล ป่านทอง

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright © by Chiang Mai University
All rights reserved