

การเปรียบเทียบประสิทธิภาพการใช้แบบจำลองแบล็ค-โชลส์ แบบจำลองไบโนเมียล
และแบบจำลองโครงข่ายประสาทเทียม เพื่อคำนวณราคาออปชัน
ในประเทศไทย ญี่ปุ่น และฮ่องกง



นภาพร ทองไทย

บริหารธุรกิจมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
มิถุนายน 2553

การเปรียบเทียบประสิทธิภาพการใช้แบบจำลองแบล็ค-โชลส์ แบบจำลองไบโนเมียล
และแบบจำลองโครงข่ายประสาทเทียม เพื่อกำหนดราคาออปชัน
ในประเทศไทย ญี่ปุ่น และฮ่องกง

นภาพร ทองไทย

วิทยานิพนธ์นี้เสนอต่อบัณฑิตวิทยาลัยเพื่อเป็นส่วนหนึ่ง
ของการศึกษาตามหลักสูตรปริญญา
บริหารธุรกิจมหาบัณฑิต

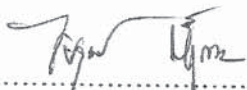
บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
มิถุนายน 2553

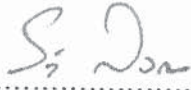
การเปรียบเทียบประสิทธิภาพการใช้แบบจำลองแบล็ค-โชลส์ แบบจำลองไบโนเมียล
และแบบจำลองโครงข่ายประสาทเทียม เพื่อคำนวณราคาอปชัน
ในประเทศไทย ญี่ปุ่น และฮ่องกง


นภาพร ทองไทย

วิทยานิพนธ์นี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา
ตามหลักสูตรปริญญาบริหารธุรกิจมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบวิทยานิพนธ์


.....ประธานกรรมการ
อาจารย์ ดร.ชัยวุฒิ ตั้งสมรัชย์


.....กรรมการ
ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.รวี ลงกานี


.....กรรมการ
ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.วรพจน์ องค์กรุทธรักษา

อาจารย์ที่ปรึกษาวิทยานิพนธ์


.....
ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.รวี ลงกานี

10 มิถุนายน 2553

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

วิทยานิพนธ์ฉบับนี้ สำเร็จลุล่วงได้อย่างสมบูรณ์จากความกรุณาของผู้มีพระคุณทุกท่าน โดยเฉพาะอย่างยิ่ง ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.รวิ ลงกานี ที่ได้อนุเคราะห์รับเป็นอาจารย์ที่ปรึกษาในการทำวิทยานิพนธ์ ตลอดจนสละเวลาอันมีค่าในการให้คำปรึกษาและคำแนะนำที่ดีเสมอมา ดังนั้น ผู้วิจัย จึงขอกราบขอบพระคุณอย่างยิ่ง

ขอกราบขอบพระคุณ อาจารย์ ดร. ชัยวุฒิ ตั้งสมชัย และ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.วรพจน์ องค์กรุทธรักษา ที่ได้สละเวลามาเป็นกรรมการสอบวิทยานิพนธ์ฉบับนี้ ซึ่งให้ข้อเสนอแนะอันเป็นประโยชน์ต่อการทำวิทยานิพนธ์ รวมถึงคณาจารย์คณะเศรษฐศาสตร์ และคณะวิศวกรรมศาสตร์ ที่ท่านมีส่วนร่วมในการประสิทธิ์ประสาทวิชาความรู้ให้แก่ผู้วิจัย

ขอขอบคุณห้องสมุดมารวย ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ศูนย์การเงินการลงทุน (FIC) คณะบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ และห้องปฏิบัติการคอมพิวเตอร์ คณะวิศวกรรมศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ ที่เอื้อเฟื้อข้อมูลและโปรแกรมที่เป็นประโยชน์ต่อการทำวิจัยอย่างยิ่ง

และขอกราบขอบพระคุณ คุณพ่อ คุณแม่ พี่ น้อง ที่ได้อบรมเลี้ยงดูและเป็นกำลังใจที่ดี มาโดยตลอด

ผู้วิจัยหวังเป็นอย่างยิ่งว่า ผลการศึกษาในครั้งนี้จะเป็นประโยชน์ต่อหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง หรือผู้สนใจทั่วไป