

การประมาณค่าและพยากรณ์ความผันผวนแฝง
ของออปชั่นดัชนี SET50



ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
เมษายน 2559

การประมาณค่าและพยากรณ์ความผันผวนแฝงของออปชั่นดัชนี SET50



การค้นคว้าแบบอิสระนี้เสนอต่อมหาวิทยาลัยเชียงใหม่เพื่อเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษา

ตามหลักสูตรปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University

All rights reserved

บัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

เมษายน 2559

การประมาณค่าและพยากรณ์ความผันผวนแฝงของออปชั่นดัชนี SET50

วรุฒม์ จรดกล

การค้นคว้าแบบอิสระนี้ได้รับการพิจารณาอนุมัติให้นับเป็นส่วนหนึ่งของการศึกษาตามหลักสูตร
ปริญญาเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต

คณะกรรมการสอบ

คณะกรรมการที่ปรึกษา

กัณฑ์พร ช่างซัด ประธานกรรมการ อาจารย์ที่ปรึกษาหลัก
(อ.ดร.กัณฑ์พร ช่างซัด) (ผศ.ดร.กัญญ์สุดา นิ่มอนุสรณ์กุล)

..... กรรมการ อาจารย์ที่ปรึกษาร่วม
(ผศ.ดร.กัญญ์สุดา นิ่มอนุสรณ์กุล) (ผศ.ดร.ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์กุล)

..... กรรมการ
(ผศ.ดร.ชัยวัฒน์ นิ่มอนุสรณ์กุล)

7 เมษายน 2559

© ลิขสิทธิ์ของมหาวิทยาลัยเชียงใหม่

กิตติกรรมประกาศ

การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สำเร็จลงได้ด้วยความกรุณาของ ผศ.ดร.กัญญ์สุดา นิมนุสสรณ์กุล ประธานที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ ที่ได้สละเวลาในการให้ความรู้ คำแนะนำ และคำปรึกษาที่มีประโยชน์ต่อการศึกษา อีกทั้งให้ความช่วยเหลือและให้การสนับสนุนในทุกด้านอย่างยิ่ง รวมถึงการตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องต่างๆ ซึ่งผู้เขียนขอกราบขอบพระคุณเป็นอย่างสูงไว้ ณ โอกาสนี้

ขอกราบขอบพระคุณ ผศ.ดร.ชัยวัฒน์ นิมนุสสรณ์กุล กรรมการที่ปรึกษาการค้นคว้าแบบอิสระ และ อ.ดร.กัณตพร ช่างชิด ประธานกรรมการสอบการค้นคว้าแบบอิสระนี้ ที่ได้กรุณาให้คำแนะนำ และให้ความช่วยเหลือในการตรวจสอบแก้ไขข้อบกพร่องต่างๆ อันส่งผลให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้สมบูรณ์มากยิ่งขึ้น

ขอกราบขอบพระคุณคุณอาจารย์ คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ รวมถึงอาจารย์วิทยากรพิเศษทุกท่าน ที่ได้ประสิทธิ์ประสาทวิชาความรู้ให้แก่ผู้เขียน ขอขอบพระคุณ บุคลากรประจำเศรษฐศาสตร์ทุกท่านที่ให้ความดูแลและอำนวยความสะดวกแก่ผู้เขียนเป็นอย่างดี และ ขอขอบคุณเพื่อนๆ นักศึกษาหลักสูตรเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิตทุกคนที่ให้การสนับสนุนและให้กำลังใจตลอดระยะเวลาที่ทำการศึกษา จนทำให้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้เสร็จสมบูรณ์ลงได้

หากแม้การค้นคว้าแบบอิสระฉบับนี้จะเป็นประโยชน์บ้าง ไม่น่าก็น้อยแก่ผู้หนึ่งผู้ใด ผู้เขียนขอมอบความดีงามให้แก่บิดา มารดา และ ครอบครัว ผู้ซึ่งให้กำลังใจและสนับสนุนผู้เขียนตลอดมา สุดท้ายนี้ผู้เขียนขอภัยในข้อผิดพลาดประการใดที่อาจเกิดขึ้นและขออภัยไว้แต่ผู้เดียว

วรุฒม์ จรดล