

บรรณานุกรม

- คงศักดิ์ เดชคุณมาก. 2550. การออกแบบและสร้างยานยนต์ภาคพื้นดินแบบอัตโนมัติควบคุม
โดยเครือข่ายประสาทเทียมชนิดแพร่กลับ. วิทยานิพนธ์ คณะวิศวกรรมศาสตร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- คมสัน สุริยะ. 2548. การวิจัยทางด้านเศรษฐศาสตร์ด้วย Neural Networks. เอกสารประกอบการ
บรรยาย คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิตติ ต้นเสนีย์. 2549. การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์ราคาหลักทรัพย์ระหว่าง
แบบจำลองนิเวศน์เน็ตเวิร์กกับแบบจำลองอาร์มาและการ์ชเอ็ม. การค้นคว้าแบบอิสระ
คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- จิตติ ธรรมอำนวย. 2541. ตราสารอนุพันธ์กับการพัฒนาตลาดการเงินไทย. การค้นคว้าแบบอิสระ
คณะบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดอนุพันธ์แห่งประเทศไทย. 2551. ข้อมูลการซื้อขาย. [ระบบออนไลน์]. แหล่งที่มา
<http://www.tfex.or.th> (22 มีนาคม 2551).
- ปิยะเชษฐ โอภาสชาติ. 2549. การพยากรณ์ระดับสินค้าคงคลังโดยวิธีโครงข่ายประสาท.
วิทยานิพนธ์ คณะวิศวกรรมศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- พิพัฒน์ พิทยาอัจฉริยกุล. 2538. อนุพันธ์ทางการเงิน. กรุงเทพฯ: มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- พรชัย ชุนหจินดา. 2548. การบริหารการเงินระหว่างประเทศ. กรุงเทพฯ: บริษัท เอ็ม เอ เอช พรินติ้ง
จำกัด.
- ภาควิชา ภาควิชา. 2551. กลยุทธ์เด็ด เคล็ดการลงทุนใน...SET50 Index Options. กรุงเทพฯ:
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- มยุรี พรพฤตพันธ์. 2544. การประเมินราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์. การค้นคว้าแบบอิสระ.
คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- วรสิทธิ์ ฐิติชนกร. 2551. โครงข่ายประสาทเทียมกับการพิจารณารับประกันภัยอุบัติเหตุส่วนบุคคล.
กรุงเทพฯ: Chulalongkorn Review.
- ศุภเชษฐ์ กันน้อม. 2547. การประยุกต์ใช้โครงข่ายประสาทเทียมเพื่อพัฒนารูปแบบการพยากรณ์
ยอดขายรถจักรยานยนต์ภายในประเทศไทย. วิทยานิพนธ์ คณะวิศวกรรมศาสตร์
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.
- สถาบันพัฒนาความรู้ตลาดทุน ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2548. การวิเคราะห์ตราสาร
อนุพันธ์. พิมพ์ครั้งที่ 1. กรุงเทพฯ: บริษัท อมรินทร์พริ้นติ้งแอนด์พับลิชชิ่ง จำกัด (มหาชน).

- สถาบันพัฒนาความรู้ตลาดทุน ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2547. **ความรู้เบื้องต้นเกี่ยวกับตราสารอนุพันธ์**. พิมพ์ครั้งที่ 1. กรุงเทพฯ: บริษัท อมรินทร์พริ้นติ้งแอนด์พับลิชชิ่ง จำกัด (มหาชน).
- อดิเรก จันทรืศด. 2550. **การเปรียบเทียบความแม่นยำในการพยากรณ์อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศระหว่างแบบจำลองนิเวรอลเน็ตเวิร์ค แบบจำลองอาร์ีมา แบบจำลองการชเอ็ม. การค้นคว้าแบบอิสระ**. คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- อัญญา ชันชวิทย์. 2550. **การอนุมานตัวแบบจำลองเพื่อกำหนดราคาสัญญาออปชันของดัชนี SET 50**. รายงานวิจัยวิชาการ คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์.
- อรทัย เมืองใจ. 2548. **การวิเคราะห์เปรียบเทียบการพยากรณ์ราคาน้ำมันเครื่องบินเจ็ทระหว่างแบบจำลอง Neural Networks และ ARIMA**. รายงานการวิจัย คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Amilon H. 2003. **A Neural Network Versus Black-Scholes: A Comparison of Pricing and Hedging Performance**. Journal of Forecaating.
- Anders U, Korn O, Schmitt C. 1998. **Improving the Pricing of Options : a Neural Network Approach**. Journal of Forecasting.
- Bennell J, Sutcliffe C. 2004. **Black-Scholes Versus Artificial Neural Networks in Pricing FTSE 100 Options**. [Online]. www.interscience.wiley.com. (August, 2009)
- Bodie Zvi, Kane Alex, and Marcus Alan J. 2007. **Investments**. Translation by Ravi Lonkani. Bangkok: McGraw-Hill.
- Cyr, Donald A. 1992. **Option Pricing: Theoretical and Empirical Issues**. Thesis Faculty of Business University of Alberta.
- De Freitas JFG, Niranjan M, Gee AH, Doucet A. 2000. **Sequential Monte Carlo Methods on Train Neural Network Model**. Neural Computations.
- De Winne R, Francois-Heude A, Meurisse B. 2001. **Market Microsturcture and Option Pricing: A Neural Network Approach**. Working Paper. Faculties Universitaires Catholiques de Mons. August.
- Dubofsky , David A. 1992. **Options and Financial Futures Valuation and Uses**. McGraw-Hill Book co. Singapore.
- Futures Industry Association. 2009. **“Asia/Pacific Volume by Region”** [Online]. <http://www.futuresindustry.org/fi-magazine-home.asp?a=971> (July, 2009)

- Garcia R, Gencay R. 2000. **Pricing and Hedging Derivative Securities with Neural Networks and A Homogeneity Hint.** Journal of Econometrics.
- Geigle DS, Aronson JE. 1999. **An Artificial Neural Network Approach to the Valuation of Options and Forecasting of Volatility.** Journal of Computational Intelligence in Finance.
- Hong Kong Futures Exchange. 2009. “**Hang Seng Index Futures & Options**” [Online].
http://www.hkex.com.hk/prod/hsifo/index_proeip.htm (May, 2009)
- Hutchinson, J.M., A. Lo, and T. Poggio. 1995. **A Nonparametric Approach to Pricing and Hedging Derivative Securities Via Learning Network.** Journal of Finance.
- Kitamura T, Ebisuda S. 1998. **Pricing Options Using Neural Networks.** Working Paper, Graduate School of Industrial Administration, Carnegie Mellon University, February.
- Lajbcygier P, Flitman A, Swan A, Hyndman R. 1997. **The Pricing and Trading of Options Using a Hybrid Neural Network Model with Historical Volatility.** Neuro Vest Journal.
- Malliaris M, Salchenberger L. 1993. **A Neural Network Model for Estimating Option Prices.** Journal of Applied Intelligence.
- Niranjan M. 1996. **Sequential Tracking in Pricing Financial Options Using Model Based and Neural Network Approaches.** In Advances in Neural Information Processing Systems Volume9, Mozer MC, Petsche T (eds). MIT Press: Cambridge.
- Osaka Securities Exchange. 2009. “**Nikkei 225 Options**” [Online].
<http://www.ose.or.jp/e/index.html> (May, 2009).
- Qi M, Maddala GS. 1996. **Option Pricing Using Artificial Neural Networks: The Case of S&P 500 Index Call Options.** In Neural Networks in Financial Engineering: Proceeding of the Third International Conference on Neural Networks in the Capital Market. New York.
- Thailand Futures Exchange. 2009. “**SET 50 Index Options**” [Online].
http://www.tfex.co.th/en/investor_corner/knowledge.html (May, 2009)
- Yao J, Li Y, Tan L. 2000. **Option Price Forecasting Using Neural Networks.** Journal of Management Science; Omega.