

## ข้อมูลอาจารย์มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์

<b>ชื่อ</b> นายอุดมศักดิ์ รักรวงษ์วาน	
<b>ตำแหน่งทางวิชาการ</b> ผู้ช่วยศาสตราจารย์	<b>สังกัด</b> ภาควิชาคณิตศาสตร์ คณะวิทยาศาสตร์
<b>การดำรงตำแหน่งบริหาร</b> -	
<b>การศึกษา</b> วิทยาศาสตร์บัณฑิต, มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์, ไทย, 2556 masters of sciences, King's College London, อังกฤษ, 2558 doctor of philosophy, King's College London, อังกฤษ, 2563	
<b>สาขาเชี่ยวชาญ/สนใจ</b> คณิตศาสตร์การเงิน, portfolio optimization, indifference pricing, utility optimization, swaps pricing	
<b>งานสอน</b> Calculus I Digital Technology Skills Engineering Mathematics III Engineering Mathematics III Financial Mathematics I Financial Mathematics II Financial Models Mathematics for Investment Selected Topics in Mathematics Selected Topics in Statistics Special Problems Special Problems Stochastic Differential Equations	
<b>โครงการวิจัย</b> ปี 2566-2568 การกำหนดราคาและป้องกันความเสี่ยงแบบกึ่งสถิติและแบบพลวัตสำหรับอนุพันธ์ที่ขึ้นอยู่กับเส้นทางของราคาในตลาดที่ไม่สมบูรณ์: วิธีในภาคปฏิบัติ (ทุนพัฒนาศักยภาพในการทำงานวิจัยของอาจารย์รุ่นใหม่ ปี 2566) ( หัวหน้าโครงการ ) ได้รับทุนจากสำนักงานการวิจัยแห่งชาติ (วช.) ปี 2568 หน่วยบ่มเพาะการวิจัยเฉพาะด้านนวัตกรรมทางสถิติและวิทยาศาสตร์ข้อมูล ( ผู้ร่วมโครงการ ) ได้รับทุนจากทุนอุดหนุนวิจัย มก.	
<b>บทความวิจัยในวารสารวิชาการ</b> ระดับชาติ - Parawee Hongsai, Montri Maleewong, udomsak rakwongwan, Chayaphon Boonchot, Sanae Rujivan, "Stochastic Modeling for SET50 Index in Thailand Using the Black-Scholes Model with A Time-Dependent Drift Parameter and Its Application to SET50 Futures Pricing", วารสารไทยการวิจัย ตำนานงาน 8 (2) (2020) 42-50 ระดับนานาชาติ - Rujivan, S, udomsak rakwongwan, "Analytically pricing volatility swaps and volatility options with discrete sampling: Nonlinear payoff volatility derivatives", COMMUNICATIONS IN NONLINEAR SCIENCE AND NUMERICAL SIMULATION 100 (-) (2021) 105849 - udomsak rakwongwan, Piyanut TANGMANUSSUKUM, Sanae RUJIVAN, "A Visualization of Air Pollution Distribution over an Observed Area Surrounded by Mountains: A Computational Approach", Trends in Sciences (Walailak Journal of Science and Technology) 18 (12) (2021) 9805-1-14 - udomsak rakwongwan, Arnon Archankul, Sanae Rujivan, Perter Bastian, "The Numerical Visualization of Air Pollution Propagation from a Single Generator to an Observed Area", Chiang Mai Journal of Science 48 (5) (2021) 1430-1443 - Sutthimat, P, Rujivan, S, Mekchay, K, udomsak rakwongwan, "Analytical formula for conditional expectations of path-dependent product of polynomial and exponential functions of extended Cox-Ingersoll-Ross process", RESEARCH IN THE MATHEMATICAL SCIENCES 9 (1) (2022) - Boonklurb, R., Duangpan, A., udomsak rakwongwan, Sutthimat, P., "A Novel Analytical Formula for the Discounted Moments of the ECIR Process and Interest Rate Swaps Pricing", Fractal and Fractional 6 (2) (2022) - Banyanee Kosapong, Petarpa Boonserm, udomsak rakwongwan, "Options portfolio optimization of exotic options written on Mini S&P500 Index in an illiquid market with Conditional Value-at-Risk (CVaR)", Thai Journal of Mathematics 2022 (special) (2022) 169-183 - Ampol Duangpan, Ratinan Boonklurb, udomsak rakwongwan, Phiraphat Sutthimat, "Analytical Formulas Using Affine Transformation for Pricing Generalized Swaps in Commodity Markets with Stochastic Convenience Yields", Symmetry 14 (11) (2022) - Yamphram, P., อ.พีรพัฒน์ สุทธิมาศ, udomsak rakwongwan, "Pricing and Hedging Index Options under Mean-Variance Criteria in Incomplete Markets", Computation 11 (2) (2023) - Anunak, P., Boonserm, P., udomsak rakwongwan, "Analytical Formula for Conditional Moments of Extended Heston-CEV Hybrid Model with Time-dependent Parameters", Chiang Mai Journal of Science 50 (3) (2023) 1-10 - ดร.อำพล ดวงเป็น, รศ.ดร.รัตนันท์ บุญเคลือบ, udomsak rakwongwan, Phiraphat Sutthimat, "Derivation of Closed-Form Expressions in Apery-like Series Using Fractional Calculus and Applications", Fractal and Fractional 8 (7) (2024) 406	

## ข้อมูลอาจารย์มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์

<b>ชื่อ</b> นายอุดมศักดิ์ รักรวงษ์วาน	
<b>ตำแหน่งทางวิชาการ</b> ผู้ช่วยศาสตราจารย์	<b>สังกัด</b> ภาควิชาคณิตศาสตร์ คณะวิทยาศาสตร์
- Kosapong, B., Boonklurb, R., udomsak rakwongwan, "Static Pricing of Exotic Derivatives Under Conditional Value-at-Risk (CVaR) in Incomplete Markets", Computational Economics (2025)	

ผลงานวิจัยนี้เป็นรายการรวบรวมระหว่างปี 1 มกราคม 2563 - 1 พฤษภาคม 2568