

## ข้อมูลอาจารย์มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์

ชื่อ นายอุดมศักดิ์ รักวงศ์วาน ตำแหน่งทางวิชาการ ผู้ช่วยศาสตราจารย์	สังกัด ภาควิชาคณิตศาสตร์ คณะวิทยาศาสตร์
<b>การดำรงตำแหน่งบริหาร</b>	
การศึกษา วิทยาศาสตร์บัณฑิต, มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์, ไทย, 2556 masters of sciences, King's College London, อังกฤษ, 2558 doctor of philosophy, King's College London, อังกฤษ, 2563	
สาขาวิชาญี่ปุ่น/สนใจ 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 Special Problems Stochastic Differential Equations	
<b>โครงการวิจัย</b>	
ปี 2566-2568 การกำหนดราคากลางและป้องกันความเสี่ยงแบบกึ่งสถิติและแบบพลวัตสำหรับอนุพันธ์ที่ขึ้นอยู่กับเส้นทางของราคาในตลาดที่ไม่สมบูรณ์: วิธีในการปฏิบัติ (ทุนพัฒนาศักยภาพในการทำงานวิจัยของอาจารย์รุ่นใหม่ ปี 2566) ( หัวหน้าโครงการ ) ได้รับทุนจากสำนักงานการวิจัยแห่งชาติ (วช.)	
<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", วารสารไทยการวิจัยดำเนินงาน 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)	
- Benyanee 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", Analytical Formulas Using Affine Transformation for Pricing Generalized Swaps in Commodity Markets with Stochastic Convenience Yields 14 (11) (2022)	
- Yamphram, P., อ.พี.พัฒน์ 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	

ผลงานวิจัยนี้เป็นรายการรวมระหว่างปี 1 มกราคม 2563 - 26 เมษายน 2567