

ข้อมูลอาจารย์มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์

ชื่อ นายอุดมศักดิ์ รั้ววงษ์วาน	
ตำแหน่งทางวิชาการ	สังกัด ภาควิชาคณิตศาสตร์ คณะวิทยาศาสตร์
การดำรงตำแหน่งบริหาร -	
การศึกษา วิทยาศาสตร์บัณฑิต, มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์, ไทย, 2556 masters of sciences, King's College London, อังกฤษ, 2558 doctor of philosophy, King's College London, อังกฤษ, 2563	
สาขาเชี่ยวชาญ/สนใจ คณิตศาสตร์การเงิน, portfolio optimization, indifference pricing, utility optimization, swaps pricing	
งานสอน Calculus I Engineering Mathematics III Engineering Mathematics III Financial Mathematics I Financial Mathematics II Financial Models	
บทความวิจัยในวารสารวิชาการ 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 ดำเนินงาน 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", 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)	

ผลงานวิจัยนี้เป็นรายการรวบรวมระหว่างปี 1 มกราคม 2563 - 18 พฤษภาคม 2565