

สถาบันวิจัยและพัฒนาแห่งมหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์

รายการผลงานวิจัย

|   |   |        |   |
|---|---|--------|---|
| ชื่อ  | ดร.ฉัตรชัย เปลี   | สังกัด | ภาควิชาคณิตศาสตร์ คณะวิทยาศาสตร์ บางเขน |
| ตำแหน่ง   | ผู้ช่วยศาสตราจารย์  |        |   |
| การศึกษา  | Ph.D., Queensland University of Technology, Australia,  |        |   |
| สาขาเชี่ยวชาญ/สนใจ  | Financial Mathematics, financial Statistics, financial Engineering  |        |   |
| <b>โครงการวิจัย</b>   |   |        |   |
| ปี 2551   | การไม่อิสระแบบพหุระยะยาวของข้อมูลอนุกรมเวลาทางการเงิน ( หัวหน้าโครงการ ) ได้รับทุนจากทุนส่วนตัว   |        |   |
| ปี 2551   | การใช้ตัวแบบพื่นสุ่มในการหาค่าโวลิติลิตี้ของดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและราคาหุ้นในประเภทต่างๆ ( หัวหน้าโครงการ ) ได้รับทุนจากทุนอุดหนุนวิจัย มก. |        |   |
| ปี 2552   | การประมาณค่าโวลิติลิตี้และค่าความเสี่ยงในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ( หัวหน้าโครงการ ) ได้รับทุนจากทุนอุดหนุนวิจัย มก.                                 |        |   |
| ปี 2552-2553  | การประมาณค่าโวลิติลิตี้ของราคาหุ้นธนาคารกรุงเทพด้วยตัวแบบพลศาสตร์ ( หัวหน้าโครงการ ) ได้รับทุนจากทุนส่วนตัว   |        |   |
| ปี 2552-2553  | การประมาณค่าโวลิติลิตี้ของราคาหุ้นปตท.โดยตัวแบบพื่นสุ่ม ( หัวหน้าโครงการ ) ได้รับทุนจากทุนส่วนตัว   |        |   |
| ปี 2554-2555  | การประมาณค่าโวลิติลิตี้ของหุ้นการบินไทยโดยการใช้ตัวแบบพื่นสุ่ม ( หัวหน้าโครงการ ) ได้รับทุนจากทุนส่วนตัว  |        |   |
| ปี 2554-2555  | การประมาณค่าโวลิติลิตี้และค่าความเสี่ยงของ SET 50 ( หัวหน้าโครงการ ) ได้รับทุนจากทุนส่วนตัว   |        |   |
| <b>บทความวิจัยในวารสารวิชาการ</b>   |   |        |   |
| ระดับชาติ   |   |        |   |
| - Siripen Pesee, Boonsong Pratipsawangwong, Chatchai Pesee, "Prevalence and risk factors associated with denture stomatitis", วารสารทันตจุฬาฯ 35 (3) (2012) 189-200   |   |        |   |
| ระดับนานาชาติ   |   |        |   |
| - Chatchai Pesee, Natthapon Mecapikanon, "Long-memory of Foreign Exchange Rate Data", Kasetsart Journal (Natural Science)(วารสารวิทยาศาสตร์ สาขาวิทยาศาสตร์) 41 (4) (2007) 792-797  |   |        |   |
| - Chatchai Pesee, "Volatility Estimation of Straits Times Index Based on the Anh-Inoue Model", Kasetsart Journal (Natural Science)(วารสารวิทยาศาสตร์ สาขาวิทยาศาสตร์) 42 (1) (2008) 191-196   |   |        |   |
| - Laddawaun Sununliganon , Thachaya Satavuthi, Chatchai Pesee, Takemgsuk Phetchuay, Plensiri Sangroongrangsri, Bhakajira Suppateepmongkol, Rinruedee Phothinamthong, Chatchai Sirirungseero, "The Effect of 4 mg Dexamethasone on Anti-inflammation and Quality of Life after Surgical Removal of The Lower Third Molar:A Split-mouth Triple-blind Randomized Placebo-controlled Study.", วิทยาศาสตร์ทันตแพทยศาสตร์ 70 (1) (2020) 72-82 |   |        |   |
| <b>บทความวิจัยในการประชุมวิชาการ</b>  |   |        |   |
| ระดับชาติ   |   |        |   |
| - Chatchai Pesee, CHARN KHETCHATURAT, "Volatility Estimation of Straits Times Index based on a dynamic model.", Annual National Symposium on Computational Science and Engineering ครั้งที่ 1 (ANSCSE) (2007)   |   |        |   |
| - Chatchai Pesee, "Fractional Brownian motion of Foreign Exchange Rate data.", Annual National Symposium on Computational Science and Engineering ครั้งที่ 1 (ANSCSE11) (2007)  |   |        |   |
| - นันทรัตน์ จวีร์รัตนชาติ, Chatchai Pesee, "Portfolio Management by the Black-Scholes Model and Capital Asset Pricing Model", การประชุมทางวิชาการครั้งที่ 57 ของมหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์ (2019)   |   |        |   |
| ระดับนานาชาติ   |   |        |   |

สถาบันวิจัยและพัฒนาแห่งมหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์

รายการผลงานวิจัย

|  |                    |        |   |
|--|--------------------|--------|---|
| ชื่อ   | ดร.ฉัตรชัย เปสีย์  | สังกัด | ภาควิชาคณิตศาสตร์ คณะวิทยาศาสตร์ บางเขน |
| ตำแหน่ง  | ผู้ช่วยศาสตราจารย์ |        |   |
| - Chatchai Pesee, Natthapon Mecapikanon, "Long-memory of Foreign Exchange Rate Data", International Conference on Mathematical Sciences 2007(ICMS'07) (2007) |                    |        |   |
| - Chatchai Pesee, "Long-Range Dependence of Financial Time Series Data", International Conference on Computational Mathematics 2008 (2008)                   |                    |        |   |

ผลงานวิจัยนี้เป็นรายการรวบรวมระหว่างปี 1 มกราคม 2550 - 27 กันยายน 2564