

เนื้อหารายวิชา

(Course Description)

ปริญญาบัณฑิต
รายวิชาคณิตศาสตร์การเงิน
ภาควิชาคณิตศาสตร์และวิทยาการคอมพิวเตอร์
คณะวิทยาศาสตร์
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

เนื้อหารายวิชา

- 2301181** **ตัวแบบคณิตศาสตร์ทางการเงิน** **3(3-0-6)**
เงื่อนไขรายวิชา : -
การประยุกต์แนวคิดทางคณิตศาสตร์ ลำดับ อนุกรม แคลคูลัส เมทริกซ์ และความน่าจะเป็น ในการวางแผนด้านการเงินและการจัดสรรสินทรัพย์
- 2301181** **FINANCIAL MATHEMATICAL MODELS** **3(3-0-6)**
FIN MATH MODEL
Condition : -
Applications of mathematical concepts : sequences, series, calculus, matrices and probability in financial planning and asset allocation.
- 2301383** **กระบวนการสโตแคสติกเบื้องต้น** **3(3-0-6)**
เงื่อนไขรายวิชา : รายวิชาที่ต้องสอบผ่าน 2301381
พื้นฐานทฤษฎีความน่าจะเป็น ตัวแบบในเวลาไม่ต่อเนื่อง การเดินเชิงสุ่ม ลูกโซ่มาร์คอฟ กระบวนการสโตแคสติกเบื้องต้นในเวลาต่อเนื่อง และการประยุกต์ทางการเงินและตลาดหลักทรัพย์
- 2301383** **INTRODUCTION TO STOCHASTIC PROCESSES** **3(3-0-6)**
INTRO STOC PROCESS
Condition : PRER 2301381
Elements in probability theory; discrete-time models, random walks, Markov chains, basic stochastic processes in continuous time, and applications in finance and security markets.
- 2301483** **วิธีทางคณิตศาสตร์ในทฤษฎีความเสี่ยง** **3(3-0-6)**
เงื่อนไขรายวิชา : รายวิชาที่ต้องสอบผ่าน 2301381
ตัวแบบคณิตศาสตร์สำหรับการประเมินความเสี่ยงและการประยุกต์ ตัวแบบความเสี่ยงระยะสั้นและระยะยาว
ตัวแบบความเสียหาย ตัวแบบการประกันภัยต่อ
- 2301483** **MATHEMATICAL METHODS IN RISK THEORY** **3(3-0-6)**
MATH MTD RISK TH
Condition : PRER 2301381
Mathematical models for risk assessment and their applications, short-term and long-term risk models, ruin models, reinsurance models.