

หลักสูตรที่เปิดรับสมัครเข้าศึกษาบางรายวิชา ภาคการศึกษาต้น ปีการศึกษา 2566

ชื่อหลักสูตร หลักสูตรวิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชาวิศวกรรมการเงิน (หลักสูตรภาษาอังกฤษ/สหสาขาวิชา)

คณะ คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี

ติดต่อสอบถามเพิ่มเติม รศ.ดร.ไทยศิริ เวทไว/พิชฌาภรณ์ ทองประไพ

Tel. : 022185618

E-mail : mfe@cbs.chula.ac.th

ข้อมูลรายวิชาเรียนสำหรับการศึกษาแบบบางรายวิชา

รหัสรายวิชา	ชื่อรายวิชา	จำนวนหน่วยกิต	วันและเวลาเรียน
2604621	ตลาดการเงินและเครื่องมือทางการเงิน FINANCIAL MARKETS AND INSTRUMENTS	2(2-0-6)	วันพุธ
			เวลา 18.00-21.00น.
2104660	แบบจำลองสโตแคสติกสำหรับงานวิศวกรรมการเงิน STOCHASTIC MODELS FOR FINANCIAL ENGINEERING	2(2-0-6)	วันพฤหัสบดี
			เวลา 18.00-21.00 น.
2104662	การหาค่าเหมาะที่สุดสำหรับงานวิศวกรรมการเงิน OPTIMIZATION FOR FINANCIAL ENGINEERING	3(3-0-9)	วันอังคาร เวลา
			เวลา 18.00-21.00 น.
2104664	สถิติสำหรับงานวิศวกรรมการเงิน STATISTICS FOR FINANCIAL ENGINEERING	3(3-0-9)	วันจันทร์
			เวลา 18.00-21.00 น.
2604639	ทฤษฎีการเงิน FINANCE THEORIES	3(3-0-9)	วันอาทิตย์
			เวลา 13.00-16.00 น.

รูปแบบการเรียนรู้ เข้าชั้นเรียน (On-site)

จำนวนที่เปิดรับ รายวิชา ไม่จำกัด

กลุ่มผู้เรียน

บุคคลทั่วไป ที่สำเร็จการศึกษาระดับปริญญาตรีขึ้นไป

อัตราค่าเล่าเรียน นิสิตหรือนักศึกษาระดับบัณฑิตศึกษาจากสถาบันอื่นเข้าศึกษาโดยไม่รับปริญญาหรือบุคคลภายนอกเข้าร่วมฟัง

♦ นิสิตคณะกลุ่มสังคมศาสตร์ ภาคการศึกษาละ 12,250 บาท

อัตราค่าธรรมเนียมพิเศษ (หน่วยเป็นบาท)

ต่อหน่วยกิต 15000

คำอธิบายรายวิชา

2604621	บทบาทและหน้าที่ของตลาดการเงิน สถาบันการเงิน และตัวกลางทางการเงิน ประเภทของตลาดการเงิน บทบาทขององค์กรกำกับดูแล ตราสารทุน ตราสารรายได้คงที่ และตราสารอนุพันธ์	Roles and functions of financial markets, financial institutions, and financial intermediaries; types of financial markets; roles of regulators; equity, fixed income and derivative securities.
2104660	ความน่าจะเป็น ตัวแปรสุ่ม การแจกแจงความน่าจะเป็น ลูกโซ่มาร์คอฟแบบเวลาไม่ต่อเนื่อง กระบวนการปัวซอง การแจกแจงแบบปกติ ลูกโซ่มาร์คอฟแบบเวลาต่อเนื่อง มาร์ติงเกล การเคลื่อนที่แบบสุ่มการเคลื่อนที่แบบบราวน์	Probability; random variables; probability distributions; discrete-time Markov chain; Poisson process; normal distribution; continuous-time Markov chain; Martingale; random walk; Brownian motion.
2104662	ค่าเหมาะที่สุดเฉพาะที่และครอบคลุม โปรแกรมเชิงเส้น ขั้นตอนวิธี หาคำตอบแบบซิมเพล็กซ์ ความสัมพันธ์คู่เชิงเส้น ความไว โปรแกรมไม่เชิงเส้น วิธีของนิวตัน เงื่อนไขของคุนและทักเกอร์ เงื่อนไขจุดเปลี่ยนโค้ง การลู่อเข้าของขั้นตอนวิธี การหาค่าเหมาะที่สุดของกลุ่มหลักทรัพย์	Local and global optimality; linear programming; simplex algorithm; linear duality: sensitivity; nonlinear programming; Newton's method; Kuhn-Tucker conditions; saddle point conditions; convergence of algorithms; portfolio optimization.
2104664	คุณสมบัติเชิงลู่เข้าของตัวประมาณค่า สถิติของการสุ่ม การทดสอบสมมติฐาน การถดถอยเชิงเส้น การถดถอยเชิงเส้น แบบถ่วงน้ำหนักปัญหาเอ็นโดเนติและการประมาณด้วยตัวแปรเครื่องมือ	Asymptotic properties of estimators; sampling statistics; hypothesis testing; linear regression; weighted linear regression; endogeneity problems and instrumental variable estimation;

	ตัวประมาณความควรจะเป็นสูงสุด การถดถอยไม่เชิงเส้น การทดสอบของวอลล์ การทดสอบอัตราส่วนค่าควรจะเป็น วิธีทั่วไปแบบโมเมนต์เกณฑ์เชิงข้อมูล	maximum likelihood estimators; nonlinear regression; Wald test; likelihood ratio test; general method of moments; information criteria.
2604639	ทฤษฎีทางการเงินที่เกี่ยวกับการตัดสินใจในการลงทุนและการบริโภคภายใต้ความแน่นอนและไม่แน่นอน ความพึงพอใจในความเสี่ยง การประยุกต์ใช้ทฤษฎีอรรถประโยชน์ที่คาดหวังในการวิเคราะห์การลงทุนตลาดสินทรัพย์แบบไร้ข้อบกพร่อง ตลาดสินทรัพย์แบบสมบูรณ์ ทฤษฎีการจัดกลุ่มหลักทรัพย์ ทฤษฎีการกำหนดราคาของสินทรัพย์ การวิเคราะห์ประเด็นการเงินธุรกิจที่สำคัญ โครงสร้างเงินทุน นโยบายเงินปันผล โครงสร้างความเป็นเจ้าของ ความไม่สมมาตรของข้อมูล	Financial theories related to investment and consumption decisions under certainty and uncertainty; risk preferences; application of expected utility theory in investment analysis; perfect asset markets; complete asset markets; portfolio theories; asset pricing theories; analysis of key corporate finance issues; capital structure; dividend policy; ownership structure; asymmetric information.