

## دوره مهندسی مالی و فیزیک اقتصاد

۲ و ۳ اسفند ۱۳۸۵

دانشکده فیزیک، دانشگاه صنعتی شریف

### برنامه روز چهارشنبه ۲ اسفند ۸۵

عنوان	سخنران	ساعت
افتتاحه	دکتر مشفق دکتر روحانی	۸:۴۵-۹:۰۰
مهندسی مالی و فیزیک مالی	دکتر شایان آرانی	۹:۰۰-۹:۴۰
ضرورت ورود دانش پژوهان فیزیک به امور مالی	دکتر عبدوه تبریزی	۹:۴۰-۱۰:۲۰
	تنفس	۱۰:۲۰-۱۰:۴۰
روابط فیزیک، اقتصاد و مالیه	پیام نوروزاد	۱۰:۴۰-۱۱:۲۰
Analysis of Nonstationary Stochastic Processes with Application to the Fluctuations in the Oil Price	دکتر جعفری	۱۱:۲۰-۱۲:۰۰
	ناهار	۱۲:۰۰-۱۳:۳۰
Behavior of Stock Markets' Memories	دکتر محمدی	۱۳:۳۰-۱۴:۱۰
ایتو، آنالیز تصادفی و ریاضیات مالی	دکتر زنگنه	۱۴:۱۰-۱۴:۵۰
	تنفس	۱۴:۵۰-۱۵:۲۰
Premium Forecasting of Insurance Company: Automobile Insurance	دکتر فولادوند	۱۵:۲۰-۱۶:۰۰
آنالیز فراکتالی افت و خیزهای قیمت در بازار سهام	دکتر موحد	۱۶:۰۰-۱۶:۴۰

برنامه روز پنج شنبه ۳ اسفند ۸۵

عنوان	سخنران	ساعت
ارتباط اقتصاد و علوم دیگر	دکتر قالیباف	۹:۰۰-۹:۴۰
Pricing Options on Electricity	دکتر زمانی	۹:۴۰-۱۰:۲۰
	تنفس	۱۰:۲۰-۱۰:۴۰
قیمت گذاری امتیازها در مدل های تلاطم تصادفی	بهناز زرگری	۱۰:۴۰-۱۱:۲۰
Evaluating the predictive performance of Value at Risk Models in Tehran Stock Exchange	دکتر رسولی	۱۱:۲۰-۱۲:۰۰
	ناهار	۱۲:۰۰-۱۴:۰۰
		۱۴:۰۰-۱۴:۴۰
		۱۴:۴۰-۱۵:۲۰

## پوسترها:

1)

Corporate Rating of Iran Stock Exchange Firms

رتبه‌بندی شرکت‌های بورسی ایران

Roham R Farzami, Ali Rasoulizadeh, Hosein Riahi

2)

Inverse Statistics in Tehran Price Index

H. Ebadi, A. Namiranian, G. R. Jafari

3)

Chaos evidence from Tehran stock exchange

Pirooz Yousefpoora, Mir Mehdi S. Esfehania, Hassan Nojumib

4)

Analysis of Nordic Electricity Market

S. Alhesani, E. Fouladvand, G. R. Jafari

5)

تحلیل چند نمایی از مدل قیمتگذاری داراییهای سرمایه ای با استفاده از مدل موجک

شاپور محمدی، شهاب الدین شمس