

بسمه تعالی
پنجمین همایش ریاضیات و علوم انسانی

چهارشنبه 97/02/19

رئیس جلسه	محل برگزاری	عنوان	برنامه	زمان
		ثبت نام		۸:۱۵ - ۸:۴۵
		افتتاحیه		۹:۰۰ - ۹:۳۰
	سالن ۱	یادگیری و نوآوری پیش نیاز دانشگاه کارآفرین	سخنرانی: دکتر حسن طائی	۹:۳۵-۱۰:۰۰
	سالن ۱	Bitcoin, Cryptocurrencies and Cryptoassets	سخنرانی: دکتر خسرو دهناد	۱۰:۰۰-۱۰:۴۰
		استراحت و پذیرایی		۱۰:۴۰-۱۱:۰۰
	سالن ۱	نقش ریاضیات در توسعه‌ی علم مالی	سخنرانی: دکتر حسین عبده تبریزی	۱۱:۰۰-۱۱:۴۰
	سالن ۱	ابزارهای کمی در بازارهای مالی	سخنرانی: دکتر امیرهامونی	۱۱:۴۰-۱۲:۲۰
	سالن ۱	طراحی و محاسبات بیمه اتکایی	سخنرانی: دکتر امیر تیموری پاینده	۱۲:۲۰-۱۳:۰۰
		ناهار و نماز		۱۳:۰۰-۱۴:۰۰
	سالن ۱	کارایی اطلاعاتی و آثار مالیسازی در بازار آتی	سخنرانی: دکتر علی خبیری	۱۴:۰۰-۱۴:۳۰
	سایت کامپیوتر	مسابقه بورس کاپ	مسابقه	۱۴:۳۰-۱۵:۱۰
	سالن ۱	ICM TALK	سخنرانی: دکتر حسینی مقدم	۱۴:۳۰-۱۵:۰۰
		استراحت و پذیرایی		۱۵:۰۰-۱۵:۳۰
	سالن ۱	برنامه آموزشی ریاضیات مالی و اشتغال دانش آموختگان ریاضیات مالی	نشست تخصصی- دکتر محمد جلوداری ممقانی، دکتر بیژن ظهوری زنگنه، دکتر عبدالساده نیسی، دکتر مسعود درخشان نو، دکتر اسماعیل بابلیان، دکتر امیر تیمور پاینده	۱۵:۳۰-۱۷:۰۰
دکتر ممقانی	سالن ۱	Valuation of CVA , DVA and BVA of cash flows based on Dependence between market risk and credit risk factors using copula function	ارائه مقاله: داوود احمدیان	۱۷:۰۰-۱۷:۲۵
دکتر نیسی	سالن ۲	پیش بینی روند روزانه بازار بورس ایران با استفاده از شبکه مارکفی	ارائه مقاله: مریم وحیدی	
دکتر ممقانی	سالن ۱	Pricing a risk management contract based on a machine learning approach	ارائه مقاله: مصطفی پور علی زاده	۱۷:۲۵-۱۷:۵۰
دکتر نیسی	سالن ۲	تخمین بازده های مورد انتظار سبدهای مالی با استفاده از مدل قیمت گذاری دارایی سرمایه و مدل بلک لیتنر من و مقایسه عملکرد این دو روش بر اساس معیارهای ارزیابی شارپ و ترینر	ارائه مقاله: مریم ضرغامی	
دکتر ممقانی	سالن ۱	Portfolio Diversification by Entropy in Various Models	ارائه مقاله: دکتر بنی هاشمی	
دکتر نیسی	سالن ۲	A Stable and Convergent Non-Standard Finite Difference Method for Fractional Black-Scholes Model of Digital Put Option Pricing	ارائه مقاله: مریم رضائی میرارکلائی	۱۷:۵۰-۱۸:۱۵
دکتر نیسی	سالن ۱	تاثیر مدل قیمت دارایی پایه در مدیریت ریسک اعتباری	ارائه مقاله: زینب عزیزی	۱۸:۱۵-۱۸:۴۰

بسمه تعالی
پنجمین همایش ریاضیات و علوم انسانی
پنجشنبه ۹۷/۰۲/۲۰

محل برگزاری	عنوان	برنامه	زمان
سالن ۱	On Stochastic Control with Partial Observations and its Application in Banking System	سخنرانی: دکتر علی دلاور خلیفی	۹:۴۰-۹:۰۰
سالن ۱	بازارهای مالی با اطلاعات نامتقارن	سخنرانی: دکتر ندا اسماعیلی	۹:۴۰-۱۰:۲۰
سالن ۱	تکنولوژی بیمه: آینده متفاوت صنعت بیمه	سخنرانی: دکتر امیرصغری	۱۰:۲۰-۱۱:۰۰
استراحت و پذیرایی			۱۱:۰۰-۱۱:۲۰
سالن ۱	Volatility spillover and volatility impulse response functions in crude oil, gold and exchange markets	سخنرانی: دکتر ناصر خیابانی	۱۱:۲۰-۱۲:۰۰
سالن ۱	کمی سازی ریسک نیاز به تغییر نگرش	سخنرانی: دکتر میثم رادپور	۱۲:۰۰-۱۲:۴۰
استراحت و پذیرایی			۱۲:۴۰-۱۳:۴۰
سالن ۱	معرفی پایگاه داده های تحقیقاتی مالی ایران	سخنرانی: آقای علی نقوی	۱۳:۴۰-۱۴:۲۰
سالن ۱	نقش و جایگان تحلیلگران کمی در آینده بازار سرمایه ایران	شست تخصصی: دکتر علی فروش باستانی، دکتر علی حبیب زکاء، دکتر محمد علی رستگار و آقای زاهر احمدی	۱۴:۲۰-۱۵:۱۵
استراحت و پذیرایی			۱۵:۱۵-۱۵:۴۰
سایت دانشکده	مسابقه بورس کاپ	نشست تخصصی-مسابقه	۱۵:۴۰-۱۶:۴۰

رئیس جلسه	محل برگزاری	عنوان	برنامه	زمان
دکتر صفدری	سالن ۲	مدل سازی تلاطم تصادفی کسری ناهموار	ارائه مقاله: فرشید نوریان	۱۴:۲۰-۱۴:۴۵
دکتر صفدری	سالن ۲	Mean-Square Convergence of Split-Step Theta Milstein Method for Stochastic Delay Differential Equations	ارائه مقاله: امیدفرخنده روز	۱۴:۴۵-۱۵:۱۰
پذیرایی و استراحت			۱۵:۱۰-۱۵:۴۰	
دکتر مدرسی	سالن ۲	بررسی ارتباط مسئله ماکزیمم سازی مطلوبیت و اندازه مارتینگل های معادل مینیمال	ارائه مقاله: مریم طهماسبی	۱۵:۴۰-۱۶:۰۵
دکتر بنی هاشمی	سالن ۳	معرفی سیستمی برای پوشش صد درصدی بیمه وسایل نقلیه در ایران	ارائه مقاله: رحیم محمودوند	
دکتر مدرسی	سالن ۲	A Stable and Convergent Non-Standard Finite Difference Method for Fractional Black-Scholes Model of Digital Put Option Pricing	ارائه مقاله: رباب کلانتر	۱۶:۰۵-۱۶:۳۰
دکتر بنی هاشمی	سالن ۳	بهینه سازی مدیریت پرتفوی با محدودیت و کنترل ریسک	ارائه مقاله: سیدمحمدعلی محسنی الحسینی	
دکتر مدرسی	سالن ۲	مطالعه ی مسائل کنترل بهینه ی تصادفی تعمیم یافته با مشاهدات جزئی و کاربرد آن در سرمایه گذاری	ارائه مقاله: علی پورشرافتان جهرمی	۱۶:۳۰-۱۶:۵۵
دکتر بنی هاشمی	سالن ۳	Exact Solutions of Time-Fractional Fokker-Plank Equation In	ارائه مقاله: آزاده نادی فر	
دکتر مدرسی	سالن ۲	VALUATION OF INTEREST RATE CEILING AND FLOOR INFRACTIONAL UNCERTAIN ENVIRONMENT BASED ON NEWINTEREST RATE MODEL	ارائه مقاله: علیرضا نجفی	۱۶:۵۵-۱۷:۲۰
دکتر بنی هاشمی	سالن ۳	Numerical methods on the Heston Option Pricing Model	ارائه مقاله: فرشته گل دوست	
دکتر مدرسی	سالن ۲	الگوهای تغییر پذیری (متقارن و نامتقارن) برای مدل کردن نوسانات بازار سهام	ارائه مقاله: آذرغیائی	۱۷:۲۰-۱۷:۴۵
دکتر بنی هاشمی	سالن ۳	تأثیر فعالیت های خارج از ترازنامه بر ریسک بانک پاسارگاد	ارائه مقاله: ناصر قائم دوست	
دکتر مدرسی	سالن ۲	structural credit risk model under stochastic interest rate and stochastic volatility with jumps	ارائه مقاله: سپیده دبستانی	۱۷:۴۵-۱۸:۱۰
دکتر بنی هاشمی	سالن ۳	سرمایه گذاری و بیمه اتکایی بهینه با ریسک طرف معامله	ارائه مقاله: بشیری گودرزی	