

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ



## دانشگاه خاتم فصلنامه مهندسی ریسک و مهندسی مالی

شاپا چاپی: ۵۳۷۲-۲۵۳۸  
شاپا الکترونیکی: ۵۳۶۴-۲۵۳۸  
دوره ۱، شماره ۲، زمستان ۱۳۹۵  
صاحب امتیاز: دانشگاه خاتم  
مدیر مسئول: مجید قاسمی  
سر دبیر: احمد پویانفر  
مدیر داخلی: خدیجه حسنلو

### هیئت تحریریه

دانشگاه علامه طباطبایی	استاد (اقتصاد)	سهیلا پروین
دانشگاه تهران	استاد (مدیریت مالی)	رضا راعی
دانشگاه علامه طباطبایی	استاد (ریاضیات مالی)	محمد جلوداری ممقانی
دانشگاه خاتم	دانشیار (حسابداری)	محسن خوش طینت
دانشگاه الزهرا	دانشیار (مالی شرکتی)	حسن قالیباف اصل
دانشگاه تهران	دانشیار (اقتصادسنجی مالی)	شاپور محمدی
دانشگاه خاتم	استادیار (مدیریت ریسک)	احمد پویانفر
دانشگاه خاتم	استادیار (مهندسی صنایع)	خدیجه حسنلو

ویراستار فنی فارسی: فاطمه شعبانی  
صفحه آرا: فاطمه شعبانی

این نشریه در پایگاه الکترونیکی دانشگاه خاتم به نشانی: <http://jferm.khatam.ac.ir> نمایه می‌شود.

آدرس نشریه: تهران - خیابان ملاصدرا، خیابان شیراز جنوبی،

خیابان حکیم اعظم، پلاک ۳۰، دانشگاه خاتم

صندوق پستی: ۳۴۸۶-۱۹۳۹۵ کدپستی: ۱۹۹۱۶۳۳۳۵۶

وب سایت: <http://jferm.khatam.ac.ir> پست الکترونیکی: [jferm@khatam.ac.ir](mailto:jferm@khatam.ac.ir)



فصلنامه مدل‌سازی ریسک و مهندسی مالی، نشریه‌ای است با رویکرد علمی- پژوهشی که با رسالت توسعه دانش مدل‌سازی ریسک و مهندسی مالی در کشور، به انتشار مقاله‌های پژوهشی مبادرت می‌کند. مقاله‌های ارسال شده پس از داوری تخصصی و در صورت تأیید هیئت تحریریه، به چاپ می‌رسد. از استادان و پژوهشگران گرامی تقاضا می‌شود با مراجعه به آدرس الکترونیکی ([jferm.khatam.ac.ir](mailto:jferm.khatam.ac.ir)) ثبت‌نام و مقاله خود را ارسال کنند. برای جلوگیری از تأخیر در داوری و انتشار به موقع مقاله، لطفاً به نکات زیر توجه فرمایید.

#### راهنمای تدوین:

۱. فقط مقالات علمی- پژوهشی دریافت می‌شود، مقاله باید حاصل کار پژوهشی و علمی باشد و قبلاً در نشریه دیگری اعم از داخلی یا خارجی و یا مجموعه مقالات سمینارها و مجامع علمی چاپ نشده و یا هم‌زمان برای نشریه دیگری ارسال نشده باشد.
- تبصره ۱. آن دسته از مقالات ارائه شده در مجامع علمی که صرفاً خلاصه آنها چاپ شده باشد (مشروط به ذکر مشخصات کامل مرجع) قابل بررسی است.
۲. مقاله باید دارای انشایی روان و از نظر دستور زبان و آیین نگارش خالی از اشکال باشد.
۳. حداکثر حجم مقاله شامل متن، شکل‌ها، نمودارها و جدول‌ها ۲۰ صفحه است.
۴. مقاله باید به طور دقیق بر اساس ساختار و عناوین زیر باشد:

**عنوان، چکیده، مقدمه، پیشینه پژوهش، روش‌شناسی پژوهش، یافته‌های پژوهش، نتیجه‌گیری و پیشنهادها، فهرست منابع و چکیده انگلیسی.**

- تبصره ۱: مشخصات نویسنده / نویسندگان به جز در صفحه اول، نباید در هیچ قسمت دیگری از مقاله ذکر شود.
- تبصره ۲: اصطلاحات خارجی با معادل‌های دقیق و رسا در زبان فارسی و نام کامل واژه و عبارت‌های اختصاری به کار رفته در متن، به زیرنویس ارجاع شوند.
- تبصره ۳: نمودارها، اشکال و جداول به صورت سیاه و سفید و با کارکرد محتوایی مناسب تهیه شود.
۵. حروف چینی مقاله باید در برنامه Word و با رعایت حاشیه ۴/۵ سانتی‌متر در هر طرف و فاصله ۵/۳۵ سانتی‌متر از بالا و پایین در صفحه A4 صورت گیرد. در متن فارسی از قلم (B Mitra) میتر نازک ۱۳ و در متن لاتین از قلم (Times New Roman) تایمز ۱۱ استفاده شود.
۶. برای منبع‌دهی از روش استاندارد APA استفاده کنید. می‌توان برای افزایش بهره‌وری و راحتی در این کار از نرم‌افزار word یا Endnote استفاده کرد، منبع دهی در داخل متن به زبان فارسی است و منابع فارسی در پایان متن به هر دو زبان فارسی و انگلیسی و به روش ذیل انجام شود.
- کتاب: نام خانوادگی نویسنده اول، حرف اول نام همان نویسنده، و نام خانودگی نویسنده دوم، حرف اول نام همان نویسنده. (سال انتشار). عنوان کتاب. شهر: ناشر.
- مقاله: نام خانوادگی نویسنده اول، حرف اول نام همان نویسنده، و نام خانودگی نویسنده دوم، حرف اول نام همان نویسنده. (سال انتشار). عنوان مقاله. نام نشریه، دوره (شماره)، صفحه شروع مقاله - صفحه پایان مقاله.

Example (1): Seyed Javadein, S. R. (2004). *Fundamentals of human resources management*. Tehran: University of Tehran press (UTP), (in persian)

Example (2): Henry C. T, Ruth J. W. (2007). *Some properties of a simple stochastic epidemic model of SIR type*, *Mathematical Biosciences*, 208(1): 76-97.

۷. این نشریه حق رد یا قبول و نیز ویراستاری مقالات را برای خود محفوظ می‌دارد و از بازگرداندن مقالات دریافتی معذور است.
۸. مقالات رد یا انصراف داده شده پس از یک ماه از مجموعه آرشیو مجله خارج خواهد شد و مجله هیچ‌گونه مسئولیتی در این زمینه نخواهد داشت.

## فهرست مطالب

عنوان	شماره صفحه
تخمین ارزش در معرض ریسک داده‌های درون‌روزی با رویکرد <i>EVT-COPULA</i> ..... احمد پویان‌فر، سید حمید موسوی	۱۲۹
نسبت‌های ارزش‌گذاری و قابلیت پیش‌بینی بازده بازار؛ شواهدی از بورس اوراق بهادار تهران ..... سید مهدی برکچیان، لیلا نصیری، علی ابراهیم‌نژاد	۱۴۵
تشخیص الگوهای تحلیل تکنیکال با استفاده از رگرسیون کرنل ..... محمد مهدی موسوی، حمیدرضا پورابراهیم	۱۶۶
پیش‌بینی ریزش ارزش سهام با استفاده از الگوریتم کاوش باکتری و الگوریتم بیز ..... رویا دارابی، سید جواد حبیب‌زاده بایگی	۱۸۵
تورش توجه محدود سرمایه‌گذار و تکیه‌گاه‌های روان‌شناختی: یک پیش‌بینی از رفتار جمعی بازار ..... آرش قربانی، مهدی صالحی، محمدرضا عباس‌زاده	۲۰۶
اثر روزهای هفته بر بازدهی معاملات دلار در ایران ..... سید حسین حسینی، احسان جعفری باقرآبادی	۲۲۵
ارائه مدلی جدید برای مدیریت ریسک در انتخاب پروژه‌های سرمایه‌گذاری با استفاده از تجزیه و تحلیل خطا و فرآیند تحلیل شبکه فازی ..... مجتبی صالحی، زهرا حسین‌پور	۲۴۴