

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

دانشگاه خاتم
فصلنامه مهندسی ریسک و مهندسی مالی



شاپا چاپی: ۲۵۳۸-۵۳۷۲
شاپا الکترونیکی: ۲۵۳۸-۵۳۶۴
دوره ۲، شماره ۱، بهار ۱۳۹۶
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



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) 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 نویسندگان / 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) میترا 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

شماره صفحه	عنوان
۱	مقایسه شاخص‌های ارزیابی ریسک سیستمی در شبکه‌های مالی: شناسایی شرکت‌های مهم از نظر سیستمی در بازار بورس تهران حسین دستخوان، ناصر شمس قارنه
۲۲	اثرات ریسک اعتباری و ریسک نقدینگی بر عملکرد بانک‌ها مهدی فردوسی، محمد حسن فطرس
۴۲	استقرار فرهنگ ریسک در مؤسسه‌های مالی آرین قلی‌پور، محمد ابویی اردکان، حسن قالیباف اصل، اصغر اسدی
۶۰	تاثیر سرمایه‌گذاری بر عملکرد مالی در بانک‌های ایران محمود محمودزاده، فرشید عفتی باران
۸۰	سیستم استنتاج نوروفازی برای معاملات بسامد بالا با استفاده از مدل مشاهده درون-روزانه علی صالح‌آبادی، سجاد فرازمنند
۹۸	چرخه عمر شرکت و ریسک سقوط و جهش قیمت سهام یونس بادآورنهندي، قادر داداش‌زاده
۱۱۵	رابطه جریان سرمایه صندوق‌های سرمایه‌گذاری، بازده بازار و ریسک سرمایه‌گذاران خرد محمد اصولیان، معین نیکوسخن