



شماره:

تاریخ:

اطلاعیه برگزاری جلسه دفاعیه

برگزاری جلسه دفاع از پایان نامه کارشناسی ارشد

عنوان پروژه:

اعتبارسنجی روش های مبتنی بر مکانیک کوانتومی مرتبه کسری در تحلیل سیستم های مالی

نام و نام خانوادگی دانشجو: هژیر علی احمدی

استاد راهنمای پروژه: آقای دکتر خالوزاده و خانم دکتر توکلی

استاد مشاور پروژه: -

ارزیاب داخلی: آقای دکتر نکویی (دانشیار)

ارزیاب خارجی: آقای دکتر تواضعی (دانشیار-دانشگاه صنعتی شریف)

چکیده (فارسی):

در این پایان نامه بازده در کلی ترین حالت، حاصل از یک فرآیند تصادفی لگاریتم پایدار با گشتاور محدود فرض شده و از یک تابع پتانسیل به منظور بهبود دقت مدل سازی توزیع احتمال بازده بهره برده شده است. در نتیجه مسئله قیمت گذاری به حل انتگرالی با کرنل متفاوت تبدیل شده که خود از یک معادله پخش مکان-کسری ناهمگن حاصل می شود. با توجه به تابع پتانسیل و ناهمگن بودن معادله مذکور و همچنین وجود عملگر مرتبه کسری رزیتز-فلر، به انتگرال مسیر جدیدی به منظور صورتبندی پاسخ معادله کرنل نیاز است. لذا انتگرال مسیر مرتبه کسری توسعه یافته و الگوریتم مونتو-کارلو انتگرال مسیر مرتبه کسری نامتقارن معرفی شده اند. در نهایت اثرات مکانیزم محدود کننده قیمت روی قیمت اختیار معامله اروپایی به عنوان کاربردی از رویکرد معرفی شده بررسی شده است.

زمان: شنبه - ۳۰ شهریور ۱۳۹۸، ساعت: ۱۳:۳۰ الی ۱۵

مکان: سالن جلسات دانشکده برق