

رزومه

نام: غلامحسین
نام خانوادگی: گل ارضی
تاریخ تولد: 1351
ش ش: 222
محل صدور: سمنان
محل تولد: مهدی شهر

سوابق تحصیلی:

- 1- کارشناسی مدیریت بازرگانی دانشگاه تهران (1373)
- 2- کارشناسی ارشد مدیریت بازرگانی (گرایش مالی) دانشگاه شهید بهشتی (1375)
عنوان پایان نامه کارشناسی ارشد :
بررسی ثبات ریسک سیستماتیک سهام عادی شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران
- 3- دکتری مدیریت مالی دانشگاه تهران (1389)
عنوان پایان نامه دکتری :
تجزیه و تحلیل رفتار جمعی سهامداران در بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از مدل فضای حالت – نمره 19/5

سوابق آموزشی:

- تدریس دروس مدیریت مالی 1 و 2 در مقطع کارشناسی از سال 1383
- تدریس دروس مدیریت مالی، مدیریت مالی بنگاه ها، مهندسی مالی، ارزش گذاری شرکتهای، مدیریت سرمایه گذاری، تئوری ها و مدیریت سرمایه گذاری، بازارها و نهادهای مالی و تصمیم گیری در مسائل مالی در مقطع کارشناسی ارشد از سال 1389
- تدریس دروس تئوری های مالی، مدیریت سرمایه گذاری پیشرفته، مدیریت ریسک مالی پیشرفته، قیمت گذاری پیشرفته ابزارهای مشتقه، تئوری پرتفوی و تخصیص دارایی ها در مقطع دکتری از سال 1396

سوابق پژوهشی:

مقالات علمی پژوهشی

- 1- مقاله "بررسی رفتار جمعی سهامداران در بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از مدل فضای حالت" دانشگاه اصفهان - فصلنامه بررسی های حسابداری مالی، شماره 4، تابستان 1389
- 2- مقاله "آزمون عمدی یا غیر عمدی بودن تبعیت جمعی سرمایه گذاران از عامل بازار در بورس اوراق بهادار تهران" مجله علمی پژوهشی بررسی های حسابداری مالی - شماره 15 - بهار 1392
- 3- مقاله "بررسی رابطه بین کیفیت سود و بازده سهام با میانجی گری مالکیت نهادی در شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران" فصلنامه بررسی های حسابداری و حسابرسی، دوره 20، شماره 2، تابستان 1392

- 4- مقاله "پیش بینی روند حرکتی قیمت سهام با استفاده از ماشین بردار پشتیبان برپایه الگوریتم ژنتیک در بورس اوراق بهادار تهران" مجله علمی پژوهشی تحقیقات مالی - دوره 15- شماره 2- پاییز و زمستان 1392
- 5- مقاله "امکان سنجی استفاد از مدل ارزش در معرض ریسک در بورس اوراق بهادار تهران (مطالعه موردی: صنعت کانه فلزی)" مجله علمی پژوهشی مهندسی مالی و مدیریت اوراق بهادار - دوره 4 - شماره 14 - بهار 1392
- 6- مقاله "بررسی رفتار جمعی سرمایه‌گذاران در بورس اوراق بهادار تهران با رویکرد مبتنی بر حجم معاملات" فصلنامه تحقیقات مالی، دوره 15، شماره 2، سال 1392
- 7- مقاله "مقایسه عملکرد روش فضای حالت با روش حداقل مربعات معمولی OLS در برازش مدل سه عاملی فاما و فرنچ جهت پیش بینی بازده، در بورس اوراق بهادار تهران" مدیریت دارایی و تامین مالی، دوره 3، شماره 2، سال 1394
- 8- مقاله "حسابداران جنایی در جستجوی تقلب و پیش بینی بازده آتی سهام" مجله علمی پژوهشی دانش حسابرسی، سال شانزدهم شماره 64، سال 1395
- 9- مقاله "بررسی تاثیر عدم تقارن اطلاعاتی بر تغییرات غیرعادی در وجه نقد شرکتهای پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران" مجله چشم انداز مدیریت مالی، دوره 6، شماره 15، سال 1395
- 10- مقاله "بررسی تاثیر بازارگرایی شرکت بر ارزش ایجاد شده سهامداران در بورس اوراق بهادار تهران" نشریه راهبردهای بازرگانی، شماره 7، سال 1395
- 11- مقاله "مقایسه دقت مدل اولسن و مدل پیوتروسکی در تبیین تغییرات قیمت سهام پذیرفته شده در بازار اوراق بهادار تهران" فصلنامه مدل سازی اقتصاد سنجی، دوره 3، شماره 3، سال 1397
- 12- مقاله "ارائه ترکیبی از برنامه ریزی پویای تصادفی تقریبی و الگوریتم ژنتیک در بهینه سازی چند مرحله ای سبد سهام با معیار ریسک GlueVaR" فصلنامه مدیریت صنعتی، دوره 11، شماره 3، سال 1398
- 13- مقاله "بررسی بیش واکنشی سهامداران و مقایسه آن در شرکت های کوچک و بزرگ در بورس اوراق بهادار تهران" مجله چشم انداز مدیریت مالی، دوره 9، شماره 25، سال 1398
- 14- مقاله "بررسی بیش واکنشی سهامداران و مقایسه آن در شرکت های کوچک و بزرگ در بورس اوراق بهادار تهران" مجله چشم انداز مدیریت مالی، دوره 9، شماره 25، سال 1398
- 15- مقاله "تعیین حق بیمه بهینه غیرعمر با استفاده از روش برنامه ریزی پویای تصادفی" فصلنامه مدیریت صنعتی، دوره 12، شماره 4، سال 1399
- 16- مقاله "طراحی مدل تعیین حق بیمه بدنه اتومبیل بهینه با تاکید بر تاثیر متغیرهای کلان اقتصادی در تابع تقاضا" فصلنامه تحقیقات اقتصادی، دوره 57، شماره 1، سال 1401
- 17- مقاله "مقایسه عملکرد الگوریتمهای تکاملی NSGAII و SPEA2 در انتخاب پرتفولیوی بهینه در بورس اوراق بهادار تهران" فصلنامه تحقیقات مالی، دوره 24، شماره 3، سال 1401
- 18- مقاله "احساس سرمایه گذاران از بازده بازار و تاثیر آن در شکل گیری رفتار جمعی با رویکردی مبتنی بر تبعیت جمعی از بتا" دوفصلنامه توسعه و سرمایه، دوره 7، شماره 1، سال 1401
- 19- مقاله "بررسی تاثیر تصمیمات احساسی سرمایه گذاران بر وقوع بحران در بورس اوراق بهادار تهران" فصلنامه راهبرد مدیریت مالی، دوره 10، شماره 2، سال 1401

20- مقاله " بررسی اثرات متقارن و نامتقارن نرخ ارز و نوسانات آن بر بازده شاخص سهام صنعت دارو با استفاده از مدل‌های خطی و غیرخطی ARDL " پژوهش‌های اقتصادی ایران

21- مقاله " ارائه مدلی جهت انتخاب پرتفولیوی بهینه مبتنی بر میانه انحراف مطلق- آنتروپی شانون با تکنیک برنامه‌ریزی آرمانی " مجله توسعه و سرمایه

22- مقاله " تبیین عوامل موثر در وقوع پولشویی " پژوهش‌های تجربی حسابداری

23- مقاله " تحلیل فقهی و اقتصادی اختیار معامله گذشته‌نگر: ابزاری نوین برای توسعه بازار سرمایه اسلامی " دانش سرمایه گذاری

24- مقاله " بررسی اثرهای اهرمی، هم‌بستگی شرطی پویا و سرایت‌پذیری تلاطم میان شاخص‌های صنایع بورسی با استفاده از مدل ARMA- DCC-GJR-GARCH تحقیقات مالی

25- مقاله " بررسی سرایت‌پذیری تلاطم میان نرخ بازده دلار، شاخص هم وزن سهام، صندوق طلا و بیت کوین با استفاده از مدل DECO- GARCH " مجله بورس اوراق بهادار

26- مقاله "مقایسه عملکرد پرتفولیوی بهینه مبتنی بر توزیع چوله - نرمال و توزیع چوله - لاپلاس - نرمال با رویکرد مبتنی بر میانگین - انحراف مطلق - آنتروپی " مجله مدیریت صنعتی

27- Article "Volatility spillover in crude oil market using Heston switching Clayton model." *Journal of Mathematics and Modeling in Finance*(2023)

28- Article " Assay the Effect of Ownership Structure on Risk-Taking Behavior in Accepted Banks in Tehran Stock Exchange." *International Business Management. Vol 10, No15.*

29- Article " Forecasting factors affecting stock price fluctuations using the scenario planning approach." *Journal of Applied Research on Industrial Engineering. Vol 10, No 4. 2023*

30- Article " Predicting the Volatility Spillover in the Tehran Stock Exchange Market with Heston Switching Copula Model" *International journal of finance and managerial accounting*

مقاله های چاپ شده در سایر مجلات (مروری)

1- مقاله « نحوه انعکاس مصوبات مجامع در فرآیند محاسبه بازده سهام عادی شرکتها » مجله بورس شماره 24

2- مقاله « آزمون ایستایی ضریب بتای سهام عادی در بورس تهران » مجله بورس شماره 37

3- مقاله " روش‌های اجرای اصل 44 قانون اساسی با نگرش به تجارب سایر کشورها " مجله بورس- شماره 73

4- مقاله " سودآوری بازار سهام در اقتصاد ایران " سیاست‌های مالی و اقتصادی، دوره 3، شماره 9، 1394

ارائه مقالات در همایش ها

- 1- مقاله " بررسی ثبات ریسک سیستماتیک سهام عادی شرکتهای پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران " در هشتمین کنفرانس سیاستهای پولی و بانکی بانک مرکزی- خرداد 1377- بصورت پوستر
- 2- مقاله " بررسی تأثیر نقد شوندگی بر دوره‌ی نگهداری سهام در بورس اوراق بهادار تهران " نخستین کنفرانس ملی حسابداری و مدیریت مالی و سرمایه گذاری، دانشگاه جامع علمی و کاربردی واحد گلستان، بهمن ماه 91
- 3- مقاله " بررسی سرعت تعدیل ساختار سرمایه صنایع مختلف در بورس اوراق بهادار تهران " پنجمین کنفرانس بین المللی مدیریت، حسابداری و توسعه اقتصادی- سال 1399
- 4- مقاله " مدل سازی و شبیه سازی الگوی رفتاری سرمایه گذاران در بورس اوراق بهادار با رویکرد دینامیک سیستم " اولین کنفرانس بین المللی مدیریت امور مالی، تجارت، بانک، اقتصاد و حسابداری، سال 1398
- 5- مقاله " ارزیابی کیفیت سود و رابطه آن با بازده سهام عادی شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران " کنگره ملی تحقیقات بنیادین در مدیریت اقتصاد و حسابداری، سال 1397
- 6- مقاله " بررسی تأثیر مسئولیت اجتماعی شرکت بر ارزش ایجاد شده سهامداران در بورس اوراق بهادار تهران " چهارمین کنفرانس ملی در مدیریت کسب و کار و بازرگانی، سال 1398
- 7- مقاله " بررسی تأثیر سطح نگهداشت وجه نقد (دارایی های نقدی) بر ارزش شرکت در سطوح مختلف مالکیت نهادی " اولین همایش سراسری علم و فناوری هزاره سوم اقتصاد، مدیریت و حسابداری ایران، سال 1397
- 8- مقاله " بررسی تأثیر ساختار مالکیت بر عملکرد بانکهای پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران " کنفرانس بین المللی حسابداری و مدیریت، سال 1393
- 9- مقاله " بررسی رابطه بین ریسک سیاسی و عملکرد مالی شرکت ها مورد مطالعه: شرکتهای پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران " چهارمین کنفرانس ملی مدیریت و حسابداری، سل 1394
- 10-مقاله " شناسایی موثرترین روش تامین مالی شرکتهای پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران " اولین کنفرانس ملی حسابداری و مدیریت، سال 1392
- 11-مقاله " مقایسه عملکرد روش های معاملاتی میانگین متحرک و خرید و نگهداری در بورس اوراق بهادار تهران " همایش ملی مدیریت و آموزش، سال 1394
- 12-مقاله " بررسی قابلیت پیش بینی سود هر سهم توسط مدل سری های زمانی ARIMA " همایش ملی مدیریت و آموزش، سال 1394
- 13-مقاله " تأثیر خودشیفتگی بر تحمل ریسک سرمایه گذاری (مطالعه موردی: سازمان بورس و اوراق بهادار تهران) " کنفرانس بین المللی حسابداری و مدیریت، سال 1393
- 14-مقاله " بررسی روابط علی میان توسعه مالی، رشد اقتصادی و شاخص فلاکت " چهارمین همایش سالانه انجمن مالی ایران، سال 1401

انجام طرح های پژوهشی

- 1- مجری طرح تحقیقاتی «بررسی نگرش سرمایه گذاران استان سمنان نسبت به سرمایه گذاری در سهام و اوراق بهادار و فراهم آوردن زمینه های استقرار بورس منطقه ای در استان» با همکاری دانشگاه سمنان و سازمان مدیریت و برنامه ریزی استان- خرداد 1381

راهنمایی پایان نامه کارشناسی ارشد

- 1- بررسی تبعیت از بتا در بورس اوراق بهادار تهران با رویکرد تمایلات سرمایه گذاران، ادریس بادیدست
- 2- بررسی اثر بخشی حد نوسان قیمت در بورس اوراق بهادار در بازارهای افزایشی و کاهشی، بهنام فلاح پور
- 2- بررسی رابطه بین بازده و نوسانات کل، روزانه و شبانه سهام در بورس اوراق بهادار تهران، مینا مصطفی قلی
- 3- پیش بینی ورشکستگی شرکت ها با استفاده از نسبتهای جریان وجه نقد، محسن قسوری
- 5- مقایسه عملکرد الگوریتم کلونی زنبور عسل مصنوعی با مدل مارکویتز در انتخاب پرتفولیوی بهینه، پیمان حاج بابایی
- 6- بررسی تأثیر ریسک سیاسی بر عملکرد مالی شرکت ها؛ مطالعه موردی: شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران، حمید رضا پروازی

7- بررسی رابطه بین کیفیت سود و بازده سهام با استفاده از متغیر تعدیل کننده مالکیت نهادی، در شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار

تهران، سعید زنگوری

8- مقایسه عملکرد الگوریتم های رقابت استعماری و فاخته در بهینه سازی سبد سهام در بورس اوراق بهادار تهران، سعید مشهدی زاده

9- پیش بینی بازده سهام توسط مدل سه عاملی فاما و فرنچ با استفاده از فیلتر کالمن و مقایسه آن با روش رگرسیون ساده در بورس اوراق بهادار تهران، اشکان چهره نگار

10- بررسی رفتار جمعی سرمایه گذاران در بورس اوراق بهادار تهران با رویکردی مبتنی بر حجم معاملات، علی اصغر ضیاچی

11- بررسی رابطه بین اهرم مالی و بازده سهام عادی شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران در صنایع مختلف، مژگان رشیدی

12 امکان سنجی استفاده از مدل ارزش در معرض ریسک در بورس اوراق بهادار تهران (مطالعه موردی: صنعت کانه فلزی)، لیلا دلاوری مرغزار

13 بررسی تاثیر متغیرهای مالی شرکت ها بر دوره نگهداری سهام در بورس اوراق بهادار تهران، بی بی بهاره قاسمی

14 مقایسه عملکرد مدل برنامه ریزی سازگار با مقادیر نامطلوب مبتنی بر رویکرد فازی، با حالت غیر فازی در انتخاب پرتفوی بهینه در بورس اوراق بهادار تهران، سیدمحمد حسینی

15 مقایسه عملکرد روش ماشین بردار پشتیبان و روش شبکه عصبی پرسپترون چندلایه در پیش بینی نکول وام های بانکی (مطالعه موردی: بانک مسکن)، مهدی روح الامینی

16 تاثیر شرایط اقتصاد کلان بر ساختار سرمایه شرکت ها با توجه به درجه اهرم مالی آن ها، الهام شاکری

17- پیش بینی بازده سهام با استفاده از مدل چهار عاملی فاما و فرنچ در بورس اوراق بهادار تهران، امیر حسین عبدوس

18- بررسی رفتار جمعی سرمایه گذاران در شرایط مختلف بازار در بورس اوراق بهادار تهران، سمیه یوسفی

19- تبیین بازده با استفاده از مدل سه عاملی جایگزین (CNZ) و مقایسه عملکرد آن با مدل سه عاملی فاما و فرنچ در بورس اوراق بهادار تهران، فرزانه اعلاءالملکی

20-