



مجتمع آموزش عالی فاطمیه نهاوند (ویژه خاوهران) / فنی و مهندسی

الهام

فرزانگان

شماره تماس:

رایانامه: [e.farzanegan@basu.ac.ir](mailto:e.farzanegan@basu.ac.ir)

وب سایت:

پروفاایل علم سنجی:

مقالات علمی چاپ شده در مجلات

■ Time-varying price discovery in Bahar-e-Azadi Gold Coin spot and futures contracts

Elham Farzanegan

Investment Management and Financial Innovations, 2022

■ Dependence structure between the TEHRAN stock exchange and the derivatives market of the IRAN mercantile exchange: Copula-GARCH approach

Elham Farzanegan

International Journal of Economics and Management, 2018

■ Optimal Design of Securitization in a Principal-Agent Relationship Based on Bayesian Inference for Moral Hazard

mohsen ebrahimi, Ezatollah Abbasian, Elham Farzanegan

Asian Research Consortium, 2014

■ بررسی ویژگی های زمان متغیر شبکه جریان اطلاعات میان شاخص های صنایع اصلی در بورس اوراق بهادار تهران

الهام فرزانگان

پژوهشنامه اقتصادی، ۱۴۰۱

■ بررسی تأثیر محدودیت های آربیتراژ و آربیتراژ نامتقارن بر صرف بازده نوسان پذیری غیرسیستماتیک در بورس اوراق بهادار تهران

الهام فرزانگان، حمیدرضا حیدری

دانش مالی تحلیل اوراق بهادار، ۱۴۰۱

■ بررسی تأثیر رفتار گله ای بر نوسان پذیری غیرسیستماتیک در صنایع فعال در بورس اوراق بهادار تهران

الهام فرزانگان، حمیدرضا حیدری

پژوهش های حسابداری مالی، ۱۳۹۹

■ بررسی بی قاعدگی نوسان پذیری غیرسیستماتیک

الهام فرزانگان، حمیدرضا حیدری

دانش حسابداری مالی، ۱۳۹۹

■ بررسی حافظه بلندمدت زمان متغیر در بورس اوراق بهادار تهران: رویکرد نماهای هرست تعمیم یافته و پنجره متحرک

الهام فرزانگان

مدیریت دارایی و تامین مالی، ۱۳۹۸

■ استراتژی های پوشش ریسک قیمت سکه بهار آزادی: مقایسه بین رویکردهای ADCC، GO-GARCH و GARCH

الهام فرزانگان

■ بی قاعدگی حباب قیمتی در بورس اوراق بهادار تهران، رویکرد محدودیت در آربیتراژ  
عزت اله عباسیان، ابراهیم نصیرالاسلامی، الهام فرزنانگان  
پژوهش ها و سیاست های اقتصادی، ۱۳۹۴

■ طراحی بهینه اوراق بهادار سازی در رابطه کارفرما کارگزار براساس رویکرد استنباط بیزین از مخاطره اخلاقی  
محسن ابراهیمی، عزت اله عباسیان، الهام فرزنانگان  
تحقیقات مالی - دانشگاه تهران، ۱۳۹۳

پایان نامه ها و رساله های دکتری

■ طراحی بهینه اوراق بهادار سازی در رابطه ی کار فرما - کارگزار براساس رویکرد استنباط بیزین از مخاطره اخلاقی  
۱۳۹۳

پایان نامه های کارشناسی ارشد

■ بررسی رابطه بین محدودیت در آربیتراژ و صرف بازدهی نوسان پذیری غیرسیستماتیک در بورس اوراق بهادار تهران  
۱۳۹۸