



علوم ریاضی / علوم بیم سنجی

ساغر

حیدری

شماره تماس: ۲۹۹۰۲۹۱۲

رایانامه: s_heidari@sbu.ac.ir

وب سایت: <https://facultymembers.sbu.ac.ir/heidari>

پرو فایل علم سنجی:

http://scimet.sbu.ac.ir/Saghar_Heidari

تحصیلات

- کارشناسی: دانشگاه صنعتی شریف - تهران، ریاضی، ۱۳۷۹ ← ۱۳۸۳
- کارشناسی ارشد: دانشگاه صنعتی شریف - تهران، ریاضی کاربردی - ریاضی مالی، ۱۳۸۴ ← ۱۳۸۶
- دکتری: دانشگاه شهید بهشتی - تهران، ریاضی کاربردی - ریاضی مالی، ۱۳۹۲ ← ۱۳۹۶

علاقی پژوهشی

■ ریاضیات مالی

■ ریاضیات محاسباتی

■ قیمت گذاری ابزارهای مالی

■ بازارهای مالی

■ روش های عددی حل معادلات دیفرانسیل جزئی

فعالیت های اجرایی

- عضو هیات مدیره انجمن علمی محاسبات بیمه و مالی ایران، ۱۴۰۱ ← ۱۴۰۱
- عضو هیات تحریریه خبرنامه انجمن علمی محاسبات بیمه و مالی ایران، ۱۴۰۱ ← ۱۴۰۱

مقالات علمی چاپ شده در مجلات

■ A stable numerical scheme for pricing American put options under irrational behavior with rationality parameter

Mohammad saber Roohi, Hossein Azari, Saghar Heidari
Filomat, Vol.37, pp. 9865-9878, 2023

■ NUMERICAL APPROACH FOR COUPLED SYSTEMS RESULTING FROM PRICING OF DERIVATIVES:
MODELING AND PRICING OF INSTALLMENT OPTIONS

Saghar Heidari

■ A Numerical Method for Pricing Perpetual American Options under Regime Switching Jump Diffusion Models

Saghar Heidari, Hossein Azari

DYNAMICS OF CONTINUOUS DISCRETE AND IMPULSIVE SYSTEMS-SERIES B-APPLICATIONS and ALGORITHMS, Vol.28, pp. 143-163, 2021

مقالات علمی ارائه شده در همایش‌ها

■ Efficiency Analysis of Performance Metrics in Using Machine Learning Algorithms for Options Pricing: An Empirical Study

Saghar Heidari, Morteza Hossein gholi poor

The 8th FinAct_IRAN international conference on Financial and Acturial mathematics, Vol.1, pp.55-59

■ Numerical Pricing of Financial Options under Irrational Exercise Times and Regime-Switching Models

Saghar Heidari

international conference on mathematics and mathematical statistics

■ Pricing American Options under Irrational Behavior

Saghar Heidari, Mohammad saber Roohi, Hossein Azari

International Conference on Financial Mathematics and Optimal Investment

■ Evaluation of bond options

Saghar Heidari

The 7th FINACT-IRAN National Conference on Financial and Actuarial Mathematics

■ A Numerical Approach for Pricing American Options Embedded in Bonds under One-Factor Short-Rate Models

Saghar Heidari

23rd International Conference on Computational Mathematics, Geometry and Statistics

■ Pricing European Continuous-Installment Options under Regime-Switching Models

Saghar Heidari

22th International Conference on Applied Mathematical Finance and Economics

AMERICAN OPTIONS UNDER M-REGIME SWITCHING JUMP-DIFFUSION MODEL WITH IRRATIONAL BEHAVIOR ■

ساغر حیدری

پنجاه و چهارمین کنفرانس ریاضی ایران، نسخه ۱، صفحات: ۱۹۸-۲۰۱

■ روش عناصر متناهی برای محاسبه قیمت اختیار آمریکایی تحت مدل رژیم سوئیچینگ با پارامتر بنیادی

ساغر حیدری، محمدصابر روحی، حسین آذری ازغندی

نهمین سمینار آنالیز عددی و کاربردهای آن

■ (ابزارهای نوظهور در بازارهای مالی (مدل بندی و شبیه سازی اوراق قرضه وقایع فاجعه آمیز

ساغر حیدری، فرزانه میر

نهمین سمینار آنالیز عددی و کاربردهای آن، صفحات: ۲۸۱-۲۸۴

■ مدل مارکوف برای مساله اختیارات تقسیتی پیوسته تحت مدل رژیم سوئیچینگ

ساغر حیدری

(ششمین همایش ریاضیات و علوم انسانی (ریاضیات مالی

■ قیمت گذاری محصولات بیمه ای متصل به دارایی به کمک اختیارات تحت مدل های جهش

ساغر حیدری

پنجاه و یکمین کنفرانس ریاضی ایران

■ روش عناصر متناهی برای مساله قیمت گذاری اختیارات تحت مدل رژیم سوییچینگ

ساغر حیدری

دومین همایش ملی ریاضی و آمار دانشگاه گنبد کاووس

■ ارزش گذاری مزایای فوت متصل به سرمایه تحت مدل های فازنوع

ساغر حیدری

ششمین کنفرانس مهندسی مالی و بیم سنجی