



نام و نام خانوادگی	رضا راعی
مرتبه علمی	استاد تمام
آدرس محل کار	---
تلفن	---
فکس	---
پست الکترونیک	raei@ut.ac.ir
آدرس وب سایت	---

#### تحصیلات

- 1) کارشناسی، 1367، مدیریت، اصفهان
- 2) کارشناسی ارشد، 1370، مدیریت، تهران
- 3) دکتری، 1377، مدیریت مالی، تهران

#### فعالیت‌های اجرایی

- 1) مدیر گروه مدیریت مالی و بیمه، 1380/08/28، 1382/08/28، ایران، تهران
- 2) مدیر گروه مدیریت مالی و بیمه، 1382/08/28، 1384/09/20، ایران، تهران
- 3) عضو هیات مدیره و قائم مقام مدیر عامل بانک توسعه صادرات، 1385/08/15، 1386/04/02، ایران، تهران
- 4) رئیس هیات مدیره و مدیر عامل بانک تجارت، 1386/04/02، 1386/09/10، ایران، تهران
- 5) معاون ارزی بانک مرکزی، 1386/09/10، 1388/05/03، ایران، تهران
- 6) مدیر گروه مدیریت مالی و بیمه، 1388/08/01، 1391/12/12، ایران، تهران
- 7) سردبیر مجله تحقیقات مالی، 1388/09/01، 1398/02/02، ایران، تهران
- 8) معاون دانشگاه و رئیس سازمان توسعه و سرمایه گذاری دانشگاه، 1389/04/02، 1392/09/12، ایران، تهران
- 9) عضو شورای برنامه ریزی گروه مدیریت وزارت علوم، تحقیقات و فناوری، 1389/10/14، 1398/02/02، ایران، تهران
- 10) سرپرست دانشکده مدیریت، 1392/05/09، 1392/09/13، ایران، تهران
- 11) قائم مقام سازمان تامین اجتماعی، 1392/09/13، 1398/02/02، ایران، تهران
- 12) عضو هیات عامل سازمان سرمایه گذاری دانشگاه تهران، 1392/09/13، 1398/02/02، ایران، تهران

#### کتاب‌های تالیفی

- 1) راعی، رضا و علی اصغر سعیدی. "مبانی مهندسی مالی و مدیریت ریسک." تهران: انتشارات سمت و دانشگاه تهران، 1389.
- 2) راعی، رضا، رضا عیوض لو و امیررضا خسروی. "نهادهای مالی." تهران: دانشگاه تهران، 1392.
- 3) راعی، رضا و عسگر نوربخش. "کاربرد آمار در علوم مالی." تهران: نگاه دانش، 1392.

#### مقالات چاپ شده در نشریات بین المللی

- 1) , Seid Javad Hosseini, Elahe Allahi, and Reza Raei. "The Chromosome Number of the Persian Gulf Shrimp penaeus semisulcatus." IRANIAN INTERNATIONAL JOURNAL OF SCIENCE 5, no. 1 (2004): 23-13.
- 2) Raei, Reza. "Risky Portfolio Selection through Neural Networks." Iranian Accounting and Auditing Review -, no. 46 (2006): 70-83.
- 3) , Reza Tehrani, Reza Raei, and Arash Faizabad . "Evaluating Iranian Investment Companies during the Years 2001 to 2005 Using Sharpe's, Treynor's and Jensen's Indexes." Journal of Economics and Business 7, no. 3 (2007): 116-103.
- 4) Raei, Reza, and Shapour Mohammadi . "Fractional Return and Fractional CAPM." Applied Economics Letters 4, no. 4 (2008): 269-275.
- 5) Raei, Reza, Shapour Mohammadi, and Mehdi Tajik. "An Intelligent Technical Analysis Using Neural Networks." Management Science Letters 1, no. 5 (2011): 355-362.

6) Raei, Reza, and Mohammad Bahrani Jahromi. "Portfolio Optimization Using a Hybrid of Fuzzy ANP, KIVOR and TOPSIS." Management Science Letters 7, no. 10 (2012): 2473-2484.

7) Namaki, Ali, Zahra Koochi Lai, Reza Raei, and Reza Tehrani. "Comparing emerging and mature markets during times of crises: A non-extensive statistical approach." PHYSICA A-STATISTICAL MECHANICS AND ITS APPLICATIONS 14, no. 392 (2013): 3039-3044.

8) Raei, Reza, and Meysam Bolgorian. "A quantile-based Time at Risk: A new approach for assessing risk in financial markets." PHYSICA A-STATISTICAL MECHANICS AND ITS APPLICATIONS 8, no. 392 (2013): 5673-5677.

9) Raei, Reza, and Paria Karimi. "Asset management using an extended Markowitz theorem." Management Science Letters 4, no. 6 (2014): 1309-1314.

10) Falah, Saeed, Reza Raei, Farid Tondnevis, and Adel Behzadi. "THE APPLICATION OF FUZZY AND ROBUST OPTIMIZATION FOR INDEX TRACKING." INTERCIENCIA 39, no. 6 (2014): 423.

11) Raei, Reza, Mohammad Bahrani Jahromi, and Sahar Kamalzadeh. "Portfolio Optimization Problem by Means of Artificial Bee Colony Algorithm, Considering various Criteria." International Journal of Computer Applications 103, no. 11 (2014): 46-52.

12) Raei, Reza, and Mohammadjavad Keshavarz. "THE RELATION BETWEEN EXCESS VOLATILITY AND TEHRAN SECURITY EXCHANGE STOCKS RETURN." International review 1, no. 2 (2017): 137-146.

#### مقالات چاپ شده در نشریات داخلی

and آرش فیض آباد . "Separating winners from losers among Iranian." Journal Of Geomatics Science And Technology 3, no. 3 (2011): -.  
1) Tehrani, Reza, Reza Raei,

2) Raei, Reza. "Development of an Index for Measuring Transparency of Central Banks." Argumenta Oeconomica 28, no. 1 (2012): 13-42.

3) Raei, Reza, Mohammad Moradi, and Hoda Eskandar. "Do Dividend Policies Signal Corporate Operating Characteristics?" Journal of Applied Finance & Banking 2, no. 4 (2012): 13-24.

for estimating the probability of default of corporate customers." Iranian Journal of Management Studies 9, no. 3 (2016): 651-673.

4) Raei, Reza, Mahdi Saeidi Kousha, Saeed Falah, and محمد اسماعیل فدایی نژاد . "A hybrid model

5) Raei, Reza, Alireza Najjarpour, and Mehran Soltani. "International Journal of Applied Business and Economic Research 291 Assessing the Relationship between the Cash Balance and Cumulative Abnormal Returns of Companies Listed in Tehran Stock Exchange." international journal of applied business and economic research 15, no. 16 (2017): 291-303.

6) Raei, Reza, Mehran Soltani, and Alireza Najjarpour. "The Relationship Between Audit Fees and Capital Structure Decisions in Companies Listed in Tehran Stock Exchange." international journal of applied business and economic research 15, no. 16 (2017): 281-290.

7) راعی ، رضا. "زنجیره های مارکوف در مدیریت." دانش مدیریت ، 16 (1111): 41-57.

8) راعی ، رضا. "شبکه های عصبی رویکردی نوین در تصمیم گیریهای مدیریت." مددکاری اجتماعی 5، 19 (1380): 133-154.

9) راعی ، رضا و سعید فلاح پور . "پیش بینی درماندگی مالی شرکتها با استفاده از شبکه های عصبی مصنوعی." تحقیقات مالی 6، 17 (1383): 39-71.

10) راعی ، رضا. "مالیه رفتاری: رویکردی متفاوت در حوزه مالی." تحقیقات مالی 2، 18 (1383): 77.

11) راعی ، رضا. "کاربرد ماشین بردار پشتیبان در پیش بینی درماندگی مالی شرکتها با استفاده از نسبت های مالی." بررسی های حسابداری و حسابرسی 15، 53 (1387): 17.

12) راعی ، رضا و سعید شیرزادی . "بررسی الگوی تغییرات فصلی در بورس اوراق بهادار تهران." پژوهشنامه اقتصادی 8، 4 (1387): 147-170.

13) پویانفر، احمد، رضا راعی و شاپور محمدی . "فرایند شکل گیری قیمت ها در بورس تهران- رویکرد ریز ساختاری." بررسی های حسابداری و حسابرسی 16، 56 (1388): 39-21.

14) ترجمان، وینا و رضا راعی . "محاسبه ریسک با معیار تسلط تصادفی و مقایسه آن با سایر معیارهای متداول در بورس اوراق بهادار تهران." دانشور رفتار 18، 2-47 (1390): 370-355.

- (15) راعی ، رضا، غلامرضا اسلامی بیدگلی و مهدی میرزاییاتی. "ارزش گذاری سهام و ناهمگنی رفتار سهامداران در بورس اوراق بهادار تهران." دانش حسابداری 2، 5 (1390): 103-126.
- (16) راعی ، رضا، روح اله فرهادی و امیر شیروانی. "رابطه در گذر زمان بین بازده و ریسک: شواهدی از الگوی قیمت گذاری دارائی سرمایه ای (ICAPM)." چشم انداز مدیریت مالی و حسابداری 1، 2 (1390): 125-140.
- (17) راعی ، رضا، شاپور محمدی و هدایت علی بیگی . "بهینه سازی سید سهام با رویکرد میانگین نیم واریانس با استفاده از روش جستجوی هارمونی." مدرس علوم انسانی 15، 3 (1390): 106-128.
- (18) راعی ، رضا، علیرضا سارنج و حجت اله انصاری. "آزمون بازگشت به میانگین در بورس اوراق بهادار تهران." دانشور رفتار 18، 50 (1390): 131-142.
- (19) راعی ، رضا، سجاد سیاح و غلامرضا مصباحی مقدم. "تبیین ابعاد فقهی، حقوقی و نظارتی قرارداد اختیار معامله در بازار مالی ایران." تحقیقات مالی 13، 32 (1390): 1-14.
- (20) راعی ، رضا و ابوزر سروش. "اعتبارسنجی مشتریان حقوقی کوچک و متوسط بانک ها با استفاده از مدل های لجیت و پروبیت." پژوهشنامه اقتصادی 12، 44 (1391): 131-147.
- (21) عیوض لو، رضا، رضا راعی و شاپور محمدی . "اثرات تقویمی در احتمال معاملات مبتنی بر اطلاعات نهانی." بورس اوراق بهادار 5، 18 (1391): 5-17.
- (22) راعی ، رضا و سید محسن فاضلیان. "بررسی و عرضه مدل رابطه بین ریسک کشوری و جذب سرمایه گذاری خارجی در کشورهای در حال توسعه (با تاکید بر جمهوری اسلامی ایران)." اندیشه مدیریت راهبردی 2، 12 (1391): 63-97.
- (23) راعی ، رضا، سعید فلاح پور و هما عامری متین. "الگوی ارزیابی ریسک مالی پروژه های ال ان جی - مورد کاربردی: پروژه ایران ال ان جی." تحقیقات مالی 14، 2 (1391): 47.
- (24) راعی ، رضا، شاپور محمدی و رضا عیوض لو. "تخمین احتمال معامله مبتنی بر اطلاعات خصوصی با استفاده از مدل های ریز ساختار بازار." تحقیقات مالی 15، 1 (1392): 17-28.
- (25) راعی ، رضا، غلامرضا عسگری و عسگر نوریخس. "عوامل موثر بر انتخاب روش های بودجه بندی سرمایه ای در شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران." مجله مدیریت دارایی و تامین مالی 1، 1 (1392): 1-12.
- (26) راعی ، رضا و احمد نبی زاده. "آزمون توزیع بازده سهام در بورس اوراق بهادار تهران." راهبرد مدیریت مالی 1، 1 (1392): 1-15.
- (27) راعی ، رضا، رضا عیوض لو و شاپور محمدی . "بررسی ریسک اطلاعات با استفاده از مدل های ریز ساختار بازار." پژوهش های مدیریت در ایران 17، 85-71 (1392): 71-85.
- (28) راعی ، رضا و حسین فلاح طلب. "کاربرد شبیه سازی مونت کارلو و فرایند قدم زدن تصادفی در پیش بینی ارزش در معرض ریسک." مجله مهندسی مالی و مدیریت اوراق بهادار 4، 16 (1392): 75-91.
- (29) اسلامی بیدگلی ، غلامرضا، رضا راعی و سحر کمال زاده. "محاسبه ارزش در معرض خطر قیمت سید نفتی اوپک با استفاده از مدل های حافظه ی بلند مدت گارچ." فصلنامه مطالعات اقتصاد انرژی 9، 39 (1392): 1-19.
- (30) راعی ، رضا، اعظم هنردوست، یونس سلمانی و پیمان تانابی. "اثر سررسید، حجم معامله و تعداد موقعیت های باز بر نوسانات قیمت قراردادهای آتی سکه طلا." فصلنامه دانش سرمایه گذاری 3، 9 (1393): 169-185.
- (31) هاشمی، سید محمد امیر و رضا راعی . "تخصیص دارایی به کمک تکنیک یکپارچه ای از روش های اقتصادسنجی (ARMA و GARCH) و فرآیند تحلیل شبکه ای (ANP)." مجله مهندسی مالی و مدیریت اوراق بهادار 5، 18 (1393): 135-162.
- (32) راعی ، رضا، محمدرضا رستمی و مریم هاشم پور. "پیش بینی سری های زمانی آشوب با استفاده از بهینه سازی کلونی مورچگان در بورس اوراق بهادار تهران." پژوهش های مدیریت در ایران 18، 1 (1393): 83-100.
- (33) راعی ، رضا، شاپور محمدی و علیرضا سارنج. "پویایی های بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از مدل گارچ نمای در میانگین سونیچینگ مارکوف." تحقیقات مالی 16، 1 (1393): 77-98.
- (34) راعی ، رضا و میثم محمودی آذر. "پیش بینی بازده آتی بازار سهام با استفاده از مدل های آرما، شبکه عصبی و نوینرزدایی موجک." مجله مدیریت دارایی و تامین مالی 2، 5 (1393): 1-16.
- (35) راعی ، رضا، سید فرهنگ حسینی و مائده کیانی هرچگانی. "بررسی توانایی نظرات کاربران شبکه های بر پیش بینی جهت و قیمت سهام در بورس اوراق بهادار تهران." فصلنامه دانش سرمایه گذاری 5، 19 (1395): 107-114.
- (36) راعی ، رضا و سید امیر هاشمی. "تخصیص دارائی استوار بر اساس پیش بینی روش های اقتصادسنجی (ARMA و GARCH) و فرض عدم قطعیت بازده و کواریانس." تحقیقات مالی 8، 3 (1395): 415-436.

37) راعی ، رضا، علی نیک عهد و مصطفی حبیبی. "پیش بینی شاخص بورس اوراق بهادار تهران با ترکیب روشهای آنالیز مولفه های اصلی، رگرسیون بردارپشتیبان و حرکت تجمعی ذرات." راهبرد مدیریت مالی 4، 15 (1395): 1-23.

38) محمدی ، شاپور، احمد نبی زاده، رضا راعی و حسن قالیباف اصل. "طراحی و تبیین مدل قیمت گذاری دارائیهای سرمایه ای روش چند نمایشی کسری با استفاده از گشتاور مرتبه بالا در بورس اوراق بهادار تهران." فصلنامه دانش سرمایه گذاری 6، 21 (1396): 215-224.

39) فلاح پور، سعید ، رضا راعی ، سعید میرزامحمدی و سید محمد هاشمی نژاد. "سنجش ارزش در معرض ریسک شرطی با استفاده از ترکیب مدل FIGARCH و نظریه ارزش فرین." فصلنامه دانش سرمایه گذاری 6، 23 (1396): 259-270.

40) راعی ، رضا و مهدی آسیما. "مقایسه عملکرد مدل قیمتگذاری دارایی سرمایه ای استاندارد و مدل قیمتگذاری دارایی سرمایه ای با در نظر گرفتن ناهمسانی واریانس شرطی متقارن و نامتقارن در بورس اوراق بهادار تهران." تحقیقات مالی 19، 4 (1396): 505-520.

41) محمدی ، شاپور، رضا راعی و محمدرضا رحیمی. "پیش بینی دامنه تغییرات طلا با استفاده از مدل ترکیبی ARIMA و شبکه عصبی." مجله مهندسی مالی و مدیریت اوراق بهادار 9، 34 (1397): 335-357.

42) راعی ، رضا، محمدجواد ایروانی و تیرداد احمدی. "شوکه های پولی و کانالهای انتقال دهنده سیاست پولی در اقتصاد ایران: با تأکید بر کانال نرخ ارز، قیمت مسکن و اعتبارات." پژوهش های رشد و توسعه اقتصادی 8، 31 (1397): 29-44.

43) راعی ، رضا، حجت الله انصاری و محمد پورطالبی جاغرق. "بررسی اثرات قدرت بازار و ساختار درآمدی بر سودآوری و ریسک ورشکستگی در نظام بانکداری ایران." راهبرد مدیریت مالی 6، 2 (1397): 60-81.

44) فلاح پور، سعید ، رضا راعی و عیسی نوروزیان. "استفاده از روش ترکیبی انتخاب ویژگی پیدرپی پیشرو شناور و ماشین بردار پشتیبان در پیش بینی درماندگی مالی شرکتهای پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران." تحقیقات مالی 20، 3 (1397): 289-304.

45) راعی ، رضا، سعید باجلان، مصطفی حبیبی و علی نیک عهد. "بهینه سازی پرتفوی چندهدفه براساس میانگین، واریانس، آنترופی و الگوریتم ازدحام ذرات." مجله مدل سازی ریسک و مهندسی مالی 2، 3 (1397): 362-379.

#### همایش های بین المللی

Yerevan. دومین کنفرانس شبکه های عصبی ایران و ارمنستان. "Portfolio Selection with Neural Networks and Emotive Learning Approach." 1) Lucas, Caro, , and Reza Raei.

2) Shahrokhsahi, Zahra, and Reza Raei. "Asian real option: new approach to project economic valuation." 2012 International Conference on Information Management, Innovation, ...

3) راعی ، رضا، فرشید مرادی و علی جمالی. "ارزیابی شرکتهای تابعه هلدینگ البرز بر مبنای BSC." کنفرانس بین المللی مدیریت، تهران.

#### عضویت در مجامع ملی و بین المللی

1) انجمن مالی ایران، عضو هیات موسس، ملی، 1394/05/12

#### همایش های داخلی

1) راعی ، رضا. "انتخاب مستقل از مدل مجموعه سهام." سی امین کنفرانس ریاضی کشور، اردبیل.

2) راعی ، رضا. "مدیریت ریسک بانکداری." مدیریت ریسک یکپارچه، تهران.

3) راعی ، رضا. "اثر رشد و توسعه بازارهای مالی در اقتصاد ایران." بازار سرمایه در ایران 1404، تهران.

4) راعی ، رضا و محمدعلی فتحی. "مدیریت ریسک پیمانکاری صنعت نفت." دومین کنگره ملی توسعه نظام پیمانکاری در صنعت نفت، تهران.

#### راهنمایی پایان نامه

1) پیش بینی شاخص سهام با استفاده از شبکه عصبی و تبدیل موجک، حنظله فندرسکی، دانشگاه تهران، 1392/06/30

2) انتخاب سید سهام بهینه مبتنی بر ارزش در معرض خطر شرطی به عنوان معیار ریسک با استفاده از تکنیک شبیه سازی تیرید، مهرداد طالبی، دانشگاه تهران، 1392/07/30

3) انتخاب پرتفوی با استفاده از الگوریتم تئوری گراف و رویکرد ماتریسی، صادق توکلی، دانشگاه تهران، 1392/08/21

4) رابطه آب و هوا با بازده سهام و نوسان بازده در بورس اوراق بهادار تهران، علی جمالی نیشابور، دانشگاه تهران، 1392/10/22

5) پیش بینی شاخص بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از مدل ترکیبی، علی استیری، دانشگاه تهران، 1392/11/19

6) تشکیل پرتفوی بر اساس روش تنومند، فاطمه رنجبرگل افشانی، دانشگاه تهران، 1392/12/20

7) بررسی مدل قیمت گذاری آربیتراژ با رویکرد ریسک نامطلوب و تاثیر متغیرهای کلان اقتصادی بر بازده سهام شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران، سهیل ذوقی، دانشگاه تهران، 1393/07/30

مشاوره پایان نامه

- 1) بهینه سازی سبد سهام توسط مدل نیم واریانس با استفاده از الگوریتم ژنتیک، نیما فرجی، دانشگاه تهران، 1391/04/04
- 2) معاملات زوجی با استفاده از رویکرد هم انباشتگی کسری، احسان رضانی فر، دانشگاه تهران، 1393/04/04
- 3) پیش بینی قیمت آتی فولاد مس و طلا با روش تجزیه STL، میلاد فروغی، دانشگاه تهران، 1393/06/25
- 4) کاربرد بهینه سازی استوار در ردیابی شاخص 50 شرکت فعال بورس اوراق بهادار تهران، فرید تندنویس، دانشگاه تهران، 1393/06/29
- 5) پیش بینی شاخص قیمت سهام با استفاده از شبکه عصبی بهینه شده با الگوریتم دسته ماهی مصنوعی، منا یوسفی، دانشگاه تهران، 1393/07/08
- 6) کاربرد برنامه ریزی پویا در انجام معاملات زوجی، پریساسادات میرعیسی خانی، دانشگاه تهران، 1393/07/12

مدیر مسئولی ، سردبیری و ...

1) Iranian Journal of Finance, scientific and research-based, 2017/08/09, 2019/02/20, 576854

- 2) سردبیر مجله تحقیقات مالی، علمی پژوهشی، 1388/11/18، 1397/12/01، 271545
- 3) عضو هیات تحریریه مهندسی مالی و مدیریت اوراق بهادار، علمی پژوهشی، 1390/05/10، 1397/12/01، 158خ
- 4) عضو هیات تحریریه چشم انداز مدیریت مالی، علمی پژوهشی، 1390/07/18، 1397/12/01، ج2456