

حمیدرضا آرین



سوابق تحصیلی

*دکترای ریاضیات مالی از دانشگاه تورنتو از سال ۱۳۸۲ تا ۱۳۸۷ (استاد راهنما: لوئیس سکو)

*کارشناسی ارشد ریاضی محض از دانشگاه صنعتی شریف از سال ۱۳۸۰ تا ۱۳۸۲ (استاد راهنما: بیژن ظهوری زنگنه)

*کارشناسی ریاضی محض از دانشگاه شریف از سال ۱۳۷۶ تا ۱۳۸۰ (استاد راهنما: بیژن ظهوری زنگنه)

*تمرکز بر روی توابع و آنالیز تصادفی و آنالیز تابعی



سوابق کاری

*رئیس لابراتوار ریسک خاتم

*استاد مدعو مالی، دانشگاه صنعتی شریف

*محقق ارشد لابراتوار ریسک تورنتو در دانشگاه تورنتو

*مدیر ارشد ریسک بازار سرمایه RBC، تحلیل ریسک جهانی، تورنتو، کانادا، از سال ۱۳۹۳ تا ۱۳۹۷

*استادیار امور مالی، دانشگاه رایرسون، دانشکده مدیریت، از سال ۱۳۹۵ تا ۱۳۹۶

*مدیر بنیاد موسسه مارتینگل، مدیریت سبد و آنالیز کمی، کانادا، از سال ۱۳۹۵ تا کنون

*مدیر ریسک، بازار سرمایه RBC، بازار معاملات اعتباری ریسک، نیویورک، ایالات متحده آمریکا، از سال ۱۳۹۱ تا ۱۳۹۳

*تحلیلگر ارشد کمی بازار سرمایه RBC، تورنتو، کانادا، از سال ۱۳۸۷ تا ۱۳۹۱

*محقق لابراتوار ریسک تورنتو، تحلیل ریسک اعتباری، تورنتو، کانادا، از سال ۱۳۸۴ تا ۱۳۸۷

*مدرس ریاضیات کسب و کار دانشگاه تورنتو، کانادا، از سال ۱۳۸۶ تا ۱۳۸۷



مدارک حرفه‌ای

*CFA: موسسه تحلیلگران خبره مالی

*FRM: مدیریت ریسک مالی انجمن جهانی ریسک

*CAIA: تحلیلگران سرمایه‌گذاری‌های جایگزین



انجمن‌های حرفه‌ای

*عضو بورد تخصصی و آموزشی انجمن CFA

*مدیر ارشد ریسک انجمن جهانی مدیران ریسک مالی FRM

*سخنران آموزشی و اجرایی مجله ریسک

*عضو انجمن ریاضیات آمریکا از سال ۱۳۸۲ تا ۱۳۸۹

*عضو انجمن ریاضیات کانادا از سال ۱۳۸۲ تا ۱۳۸۹

مطالعات پژوهشی



*Principles of Financial Mathematics (In Farsi), 2018, In preparation for publication. (With Shiva Zamani and Erfan Salavati)

*Shifted Wishart Process, 2018, in preparation for publication (with Marcos Escobar, Khosro Safi)

*Jamshidian Decomposition for Pricing Energy Commodity Swaptions, Jan 2013, Risk Magazine 2013, pp. 47-53. (With Ion Rada)

*The Credit Grades Model with Stochastic Covariance Wishart Process, Nov 2012, Journal of Mathematical Finance, 2012, Vol. 2 No. 4, PP. 303-313. (With Marcos Escobar, Luis Seco)

*Financial Engineering of Stochastic Correlation in Credit Risk Models, Aug 2009, University of Toronto PHD Thesis, Department of Mathematics.

*Pricing and Calibration of a Stochastic Correlation Credit Risk Model, Seo 2008, Working Paper, 2008 (with Marcos Escobar, Luis Seco)

سخنرانی‌ها



*Correlation Risk Modeling and Optimal Portfolio May 2017. Global Derivatives Trading and Risk Conference, Barcelona, Spain

*Incorporation of Liquidity into Large-Scale Portfolio Risk Measures, September 2016. Risk USA Conference, New York, USA

*A Systematic Approach to Factor Modeling of Hedge Funds, May 2016. Global Derivatives Trading and Risk Conference, Budapest, Hungary

* Modeling Stochastic Correlation in Financial Markets, May 14, 2008. Industrial Conference in Enterprise Risk Management, Wuhan, China

دانشجویان



*سامان وهابی، دکتری، دانشگاه شهید بهشتی

*محمد قنبری، کارشناسی ارشد، دانشگاه صنعتی شریف

*اسحاق جهانگیری، کارشناسی ارشد، دانشگاه صنعتی شریف

*آیدین صالحی، کارشناسی ارشد، دانشگاه صنعتی شریف

*ناهید جوادی، کارشناسی ارشد، دانشگاه صنعتی شریف

*احسان طباطبایی، کارشناسی ارشد، دانشگاه صنعتی شریف