

# Математическое и компьютерное моделирование в экономике, страховании и управлении рисками – 2017. Программа

9 ноября, четверг

Время	Докладчик	Название доклада
<b>Х корпус СГУ, ауд. 503</b>		
09.00–10.30	Регистрация участников	
10.30–10.40	Торжественное открытие конференции	
	Чумаченко А. Н., ректор Саратовского госуниверситета	
	Бирюкова Е. А., глава Отделения по Саратовской области Волго-Вятского Главного управления ЦБ РФ	
	Мхитарян В. С., руководитель Департамента статистики и анализа данных НИУ ВШЭ	
10.40–12.00	<b>Сессия 1а</b> (председатель: Мхитарян В. С.)	
	Якунина А. В.	Финансовая система России: новые реалии и риски
	Островская Е. А.	Использование математических методов при анализе и прогнозировании экономических показателей
	Павлюк Д.	Модель производственной границы с пространственными эффектами: процесс исследования
12.00–12.10	Перерыв	
12.10–13.10	<b>Сессия 1б</b> (председатель: Мхитарян В. С.)	
	Тележкина М. С., Максимов А. Г., Максимова Н. В.	Do Students Expect Any Returns on Effort Applied to Studying? An Econometric Analysis of Determinants of the Amount of Expected Wage after Graduation
	Гераськин М. И., Кузнецова О. А.	Agents' Interaction Algorithm in a Strongly Coupled System with a Transferable Utility
	Выгодчикова И. Ю., Гусятников В. Н.	Моделирование динамических рядов интервальных данных с использованием сплайн-аппроксимации и минимаксного критерия
13.10–14.00	Обеденный перерыв	

**Х корпус СГУ, ауд. 503**

14.00–16.00	<b>Сессия 2</b> (председатель: Балаш В. А.)	
	Лакшина В. В.	Hedging and Risk Aversion on Russian Stock Market: Strategies Based on MGARCH and MSV Models
	Плотникова В. В., Шиловская М. С., Дворак А. А.	The application of methods of semantic and correlation analysis through studies of the annual reports of Russian companies according to the principle of integrated reporting "reliability and completeness"
	Гудков А. А., Файзлиев А., Левшунов М. А.	Greedy Algorithm for Sparse Monotone Regression
	Аганин А. Д., Пересецкий А. А.	Сравнение моделей волатильности на данных российских биржевых индексов
	Фатьянова М. Э.	Формирование оптимального портфеля опционов с учетом гарантийного обеспечения
	Васильева Т. А., Селиверстов И. В.	Об одном оптимизационном подходе к отысканию эффективной границы множества портфелей по Марковицу
16.00–16.15	Перерыв	

**Х корпус СГУ, ауд. 503**

16.15–18.00	<b>Сессия 3</b> (председатель: Максимов А. Г.)	
	Широбокова М. А.	Методика определения уровня отсеечения скоринговой модели на основе финансового результата по портфелю
	Глухов В. Н., Додонова Н. Л., Кузнецова О. А.	Description of the Process of Clustering Business Games on Distribution of Restricted Resources by the Modified Groves-Ledyard Mechanism
	Пивкин К. С.	Кластеризация временных рядов как этап прогнозирования покупательского спроса
	Трепакова В. С., Лискина Е. Ю.	Исследование зависимости объема продаж товара повседневного спроса в торговой сети от размера рекламной скидки на этот товар у дистрибьютора
	Алексян Г. Р.	Применение информационных технологий для оптимизации работы тендерного отдела фирмы
	Файзлиев А. Р., Чекмарева А. Ж., Аникин П. К.	Построение графа на основе данных новостной аналитики

	Выгодчикова И. Ю., Фарвазетдинова Е. М.	Об аппроксимации параметров процесса денежных накоплений индивида
--	--	--

*10 ноября, пятница*

Время	Докладчик	Название доклада
<b>Х корпус СГУ, ауд. 503</b>		
10.00–11.30	<b>Сессия 4а</b> (председатель: Пересецкий А. А.)	
	Балаш В. А., Файзлиев А. Р.	Анализ сети со-упоминаний компаний в новостных сообщениях
	Сидоров С. П.	Жадные алгоритмы в задачах выпуклой оптимизации
11.30–11.40	Перерыв	
11.40–13.00	<b>Сессия 4б</b> (председатель: Пересецкий А. А.)	
	Мхитарян В. С., Карелина М. Г., Ринт Н.	Econometric modeling of integration activity in the Russian economy
	Павлюк Д.	Study of a spatial structure of urban traffic flows using a regime-switching vector autoregressive model
	Безруков А. И., Грахольская Л. В., Погожильская Г. Г.	Сравнение методов обработки результатов тестирования с точки зрения минимизации рисков первого и второго рода
	Родионов Р. Б., Рыхлов Д.	Big точность управления рисками кредитного портфеля банка
13.00–14.00	Обеденный перерыв	
<b>Х корпус СГУ, ауд. 503</b>		
14.00–15.30	<b>Панельная дискуссия «Риски криптовалют и перспективы их развития в России»</b> (модератор: Гришина Н. П.)	
	Маркелов В. В., адвокат, управляющий партнёр Маркелов Групп, Член Совета Адвокатской палаты Саратовской области, Ассоциации юристов России	
	Горынин Д., специалист-эксперт в области финансовых технологий	
	Гусева Н., специалист по инвестициям АО «Финам»	
15.30–15.45	Перерыв	

**Х корпус СГУ, ауд. 503**

15.45–19.00	<b>Сессия 5</b> (председатель: Дудов С. И.)	
	Фирсова А. А., Макарова Е. А.	Computer Cognitive Modeling of the Innovative System for the Exploration of the Regional Development Strategy
	Шебалдин В. Р.	Необходимые условия экстремума в модели Рамсея с ограничениями на горизонт управления
	Долговская Ю. А.	Создание торгового робота для автоматической торговли на фондовом рынке
	Ибрагимова М. А.	Математическая модель для представления критических сочетаний событий
	Семернина Ю. В., Якунина А. В., Нестеренко Е. А., Якунин С. В., Коробов Е. А.	Evaluation of reinvestment risk for bond portfolios
	Хуссейн И. Я.	Риски современной модели рынка капитала: причины возникновения и возможности снижения
	Королькова Н. А.	Оценка стоимости барьерных опционов методом Монте-Карло
	Тали М. М.	Влияние кредитных рисков на участие коммерческих банков в кредитовании реальных инвестиций в Ираке в период 2007-2012 гг.
	Исляев С.	The volatility surface arbitrage in stress testing framework: review and current practices

**IX корпус СГУ, ауд. 322**

15.45–18.00	<b>Сессия 6</b> (председатель: Файзлиев А. Р.)	
	Плешаков М. Г., Просвирина С. М.	Об одном генетическом алгоритме
	Харламов А. В., Ивлиев А. Р.	Динамика коэффициентов эконометрических моделей
	Шаталина А. В., Серова М. В.	Создание оптимального портфеля
	Луньков А. Д.	Динамические и пространственные аспекты ценообразования в регрессионных моделях на российском рынке недвижимости

	Малярова М. В.	Применение конвергентной и гиперконвергентной инфраструктуры для обеспечения безопасности электронной коммерции
	Камышова Г. Н., Дудов С. И., Терехов П. О.	Об одном подходе к прогнозированию на зерновом рынке на основе ценового коридора
	Челнокова О. Ю., Плуталова А. В.	Моделирование развития малого предприятия в экономике
	Борисова Л. В., Князева М. А.	Реализация генетического алгоритма для решения задачи оптимального портфельного инвестирования с ограничениями на кардинальность
	Борисова Л. В., Сагаева И. Д.	Особенности зависимости величины дохода и вероятности разорения при перестраховании

*11 ноября, суббота*

Время	Докладчик	Название доклада
<b>IX корпус СГУ, ауд. 322</b>		
10.00–13.00	<b>Сессия 7</b> (председатель: Плешаков М. Г.)	
	Тряпкина Т. С.	Алгоритмы анализа распределения степеней в сетевых структурах
	Белов Г. С.	Инструментальные средства анализа социальных сетей и их применение к проблемам исследования распространения информации
	Свечников Е. А.	Информационное обеспечение страхового бизнеса.
	Власов В. А., Ройзман А. И.	Задача распознавания речи и алгоритмы ее решения
	Алексеев Д. А.	Разработка жадных алгоритмов для обучения искусственных нейронных сетей.
	Кондратьева Е. В., Кондратьева О. Ю.	Использование жадных алгоритмов для решения некоторых задач оптимизации
	Кондратьева Е. В., Кондратьева О. Ю.	Анализ эффективности прогнозирования успеваемости на основе Fuzzy Logic
	Спиридонов К. Н.	Алгоритм сглаживания временных рядов

	Коротковская Е. С.	Принципы и методы разработки стратегий инновационной деятельности российских предприятий
	Кузнецова М. А.	Использование рядов по мультипликативным системам
	Сенокосова О. В.	Моделирование динамики доли трудоспособного населения в Саратовской области
	Дранищева А. Л.	Модели временных рядов в анализе рынка акций
	Серова М. В.	Формирование оптимального портфеля ценных бумаг
	Зайнышева Д. А.	Методы аппроксимации в задачах машинного обучения.
	Лю С. В.	Эконометрическое моделирование экономического роста
13.00–14.00	Обеденный перерыв	
<b>IX корпус СГУ, ауд. 322</b>		
14.00–18.00	<b>Сессия 8</b> (председатель: Сидоров С. П.)	
	Моренко Р. А.	Программный комплекс для тестирования торговых стратегий
	Андреева А.	Анализ влияния учетных ставок на доходность финансовых операций в сфере банковского кредитования
	Луныков А. Д., Сидоров С. П., Файзлиев А. Р.	Использование CoVaR-показателей для анализа взаимосвязи между биржевыми индексами
	Удинцов В.	Анализ и моделирование риска финансирования инновационных проектов
	Евстифеева С.	Динамика денежных накоплений индивида для различных режимов взносов и выплат
	Балаш О.С., Пешков М.С.	Анализ рисков микрофинансовых организаций с государственной и частной ресурсной базой
	Шепелев Д. В.	Расчет показателей риска VaR и Cvar с использованием копула-функции
	Мухина А. И.	Информационное обеспечение фундаментального анализа

	Попова А. А.	Некоторые методы фундаментального анализа финансовых рынков
	Лунгу В. С.	Методы прогнозирования условной волатильности и их использование в управлении рыночным риском
	Свинцицкая А. И.	Алгоритмы формирования диверсифицированного портфеля, реализация и сравнение результатов
	Коротковская Е. В.	Особенности регулирования консультационной деятельности в современных условиях
	Коротковская Е. В., Степанов И. И.	Консультационные услуги как форма развития предпринимательства современной России
	Иванова А. О.	Особенности оценки рисков финансирования инновационных проектов
	Кантемиров М. Х.	Совершенствование информационного обеспечения технического анализа
	Сторожилов А. В.	Оценка рисков операций с облигациями на фондовом рынке
	Лебедева В. Е.	Оценка стоимости барьерных опционов методом Монте-Карло
	Уваров А. Н.	Прогнозирование значений котировок ценных бумаг с использованием нейронных сетей по высокочастотным данным
	Уваров М. Н.	Использование комитетов искусственных нейронных сетей для прогнозирования финансовых показателей фармацевтических компаний
	Рыгина Е. Ю.	Калибровка двухфакторных моделей динамики процентных ставок
	Маслиенко М. П.	Реализация и тестирования некоторых методов технического анализа
	Раймер Е. Д.	Элементы системы финансирования управления рисками

# Контакты организационного комитета

**Почтовый адрес:** 410012, г. Саратов, ул. Астраханская, 83  
СГУ, IX корпус, Механико-математический факультет, ауд. 322

**Телефон:** (+7 8452) 21-06-84

**Факс:** (+7 8452) 26-15-54

**Эл. почта:** [RiskInstitute@sgu.ru](mailto:RiskInstitute@sgu.ru)

**Сайт:** <http://ri.sgu.ru/>

**Сайт конференции:** <http://risk2017.sgu.ru/>