

Саратовский государственный университет им. Н. Г. Чернышевского
International Science Association (ISCASS)



Международная молодежная научно-практическая конференция
«**МАТЕМАТИЧЕСКОЕ МОДЕЛИРОВАНИЕ
В ЭКОНОМИКЕ, СТРАХОВАНИИ
И УПРАВЛЕНИИ РИСКАМИ**»

International Youth Research and Practice Conference

“**MATHEMATICAL MODELLING IN ECONOMICS,
INSURANCE AND RISK MANAGEMENT**”

Программа Program

Саратов, 5–8 ноября 2013 г.
Saratov, November 5–8, 2013

risk2013.sgu.ru

Оргкомитет конференции

Коссович Леонид Юрьевич, д. ф.-м. н., профессор, Президент СГУ
(*председатель*);

Мхитарян Владимир Сергеевич, д. э. н., профессор, заведующий отделением статистики, анализа данных и демографии НИУ «Высшая школа экономики»
(*зам. председателя*);

Балаш Владимир Алексеевич, д. э. н., профессор кафедры математической экономики СГУ (*зам. председателя*);

Дудов Сергей Иванович, д. ф.-м. н., профессор, заведующий кафедрой математической экономики СГУ;

Кормак Лукас, Лондон, Великобритания, профессор;

Париш Дате, Лондон, Великобритания, профессор;

Роджерсон Грэм, Киль, Великобритания, профессор;

Сидоров Сергей Петрович, к. ф.-м. н., доцент, руководитель Института рисков СГУ;

Танк Фатих, Анкара, Турция, профессор;

Файн Джейсон, Северная Каролина, США, профессор;

Эрчетин Шефика Шуле, Анкара, Турция, профессор.

Organizing Committee

Dr. **Leonid Kossovich**, Professor, SSU President (*Chairman*);

Dr. **Vladimir Mkhitaryan**, Professor, Head of the Department of Statistics, Data Analysis and Demography of the “Higher School of Economics” State University (*Vice-Chairman*);

Dr. **Vladimir Balash**, Professor, Department of Mathematical Economics of SSU (*Vice-Chairman*);

Dr. **Sergey Dudov**, Professor, Head of the Department of Mathematical Economics of SSU;

Dr. **Cormac Lucas**, London, UK, Professor;

Dr. **Paresh Date**, London, UK, Professor;

Dr. **Graham Rogerson**, Keele, UK, Professor;

Dr. **Sergey Sidorov**, Associate Professor, Head of the SSU Risk Institute;

Dr. **Fatih Tank**, Ankara, Turkey, Professor;

Dr. **Jason P. Fine**, North Carolina, USA, Professor;

Dr. **Şefika Şule Erçetin**, Ankara, Turkey, Professor.

График проведения конференции

5 ноября, вторник

09.00–17.00 Регистрация участников

6 ноября, среда

09.00–09.30 Регистрация участников

09.30–10.00 Торжественное открытие

10.00–13.00 Пленарные заседания

13.00–14.00 Обеденный перерыв

14.00–16.00 Заседание секций

16.00–16.15 Перерыв

16.15–18.00 Заседание секций

7 ноября, четверг

10.00–13.00 Заседание секций

13.00–14.00 Обеденный перерыв

14.00–15.30 Продолжение пленарных заседаний

15.30–15.45 Перерыв

15.45–18.00 Заседание секций

8 ноября, пятница

9.00–18.00 Отъезд участников

Места и время заседаний

Дата \ Аудитория	X корпус СГУ, ауд. 503	IX корпус СГУ, ауд. 402	IX корпус СГУ, ауд. 322
5 ноября			09.00–17.00
6 ноября	09.00–13.00	14.00–18.00	14.00–18.00
7 ноября	10.00–13.00	14.00–18.00	14.00–18.00
8 ноября			09.00–17.00

Conference Schedule

November 5, Tuesday

09.00–17.00 Registration

November 6, Wednesday

09.00–09.30 Registration

09.30–10.00 Opening ceremony

10.00–13.00 Plenary presentations

13.00–14.00 Lunch break

14.00–16.00 Section presentations

16.00–16.15 Break

16.15–18.00 Section presentations

November 7, Thursday

10.00–13.00 Section presentations

13.00–14.00 Lunch break

14.00–15.30 Plenary presentations

15.30–15.45 Break

15.45–18.00 Section presentations

November 8, Friday

9.00–18.00 Departure

Time and Place of Sessions

Date \ Room	X build. of SSU, room 503	IX build. of SSU, room 402	IX build. of SSU, room 322
November 5			09.00–17.00
November 6	09.00–13.00	14.00–18.00	14.00–18.00
November 7	10.00–13.00	14.00–18.00	14.00–18.00
November 8			09.00–17.00

Программа конференции

6 ноября, среда

Время	Докладчик	Название доклада
X корпус СГУ, ауд. 503		
09.00–09.30	Регистрация участников	
09.30–10.00	Торжественное открытие конференции	
	Мхитарян В. С.	Приветственное слово участникам
	Стальмахов А. В.	Приветствие участникам
	Шуле Э. Ш.	Приветственное слово участникам
10.00–13.00	Пленарное заседание (председатели: Мхитарян В. С., Балаш В. А.)	
	Дудов С. И.	О новых индикаторах рынка ценных бумаг
	Гусятников В. Н., Гончаров Г. С.	Математическая модель энергопотребления в организациях бюджетного сектора
	Нестеренко Е. А.	Особенности формирования антирисковой политики в кредитных предпринимательских структурах
	Ермакова Е. А.	Моделирование управления долговыми рисками в регионе
	Носов В. В., Котар О. К.	Оптимизация величины субсидий в бюджете субъекта РФ на сельскохозяйственное страхование
13.00–14.00	Обеденный перерыв	
IX корпус СГУ, ауд. 402		
14.00–16.00	Заседание Секции А (председатель: Балаш В. А.)	
	Жадан И. Э.	Процесс принятия решений
	Варюхин А. М., Гришина Н. П.	Genetic Algorithm and Method Monte Carlo Approach for Prospect Theory Model with Cardinality Constraint
	Балаш О. С., Балаш В. А.	Моделирование процессов роста численности населения российских городов
	Мурзаков С. Н., Челнокова О. Ю.	Замечания о практическом применении модели Марковица

	Магомедова Е. С.	Многомерные статистические методы как математический инструментарий исследования проблемы трудоустройства лиц с ограниченными возможностями
	Калашникова Н. Н.	Критерии управления рисками лесохозяйственного комплекса в условиях его устойчивого развития
	Зеленый Д. Д., Васильева Т. А.	Оценивание азиатских опционов с применением разностных схем
	Гайворонская Н. Н.	Страхование и управление рисками
IX корпус СГУ, ауд. 322		
14.00–16.00	Заседание Секции В (председатель: Балаш О. С.)	
	Архипов А. П., Бойко О. В.	Модернизация системы социального страхования от несчастных случаев на производстве и профессиональных заболеваний
	Ткаченко Н. В.	Моделирование параметров квотного и эксцедентного договоров перестрахования
	Михайлова С. С.	Прогноз экономической активности лиц пенсионного возраста Республики Бурятия
	Сысоева Е. А., Агейкина Т. А.	Комплексное моделирование антропогенного загрязнения атмосферы в регионе (на примере Республики Мордовия)
	Привалова Е. Н.	Защита прав потребителей страховых услуг в развивающихся странах
	Привалова И. Н.	Информационные технологии - основа конкурентоспособности на рынке банковских услуг Украины и стран СНГ
	Чуприс Л. С.	Влияние участников рынка на устойчивость страхового фонда
	Сабина А. В.	Технико-экономический анализ энергетической эффективности для многоквартирного дома
	Ханнанова Л. Р.	Сценарий соц.-экономич. развития системы страхования урожая с/х культур
	Ханнанова Л. Р.	Совершенствование процесса урегулирования убытков в новой системе страхования урожая с/х культур
	Шехольцева О. Г.	Применение логистической регрессии при построении fraud-скоринговой карты в коммерческом банке

16.00–16.15	Перерыв	
IX корпус СГУ, ауд. 402		
16.15–18.00	Заседание Секции А (председатель: Балаш В. А.)	
	Устьянцева О. В.	Экологические риски в системе обеспечения экологической безопасности: правовой подход
	Торопова Т. В., Трегубова А. А., Ярасханова Э. У.	Статистическое моделирование сберегательного поведения домохозяйств
	Хомченко А. А.	Pseudo Binary Differential Evolution Algorithm for Cardinality Constrained Portfolio Optimization
	Файзлиев А. Р.	Пространственные модели объектов городской среды
	Трибунская В. А.	Анализ финансовой системы России с использованием меры риска CoVaR
	Степанов А. Н.	Влияние экономического кризиса на интеграцию международных финансовых рынков
	Малинский А. И.	Факторный анализ российского рынка государственных облигаций
	Ревуцкий А. С.	Анализ эффективности индикаторов информационных агентств в моделях условной волатильности
	Грибова Е. В.	Моделирование интегрального индикатора мировой вовлеченности в «зеленую экономику»
IX корпус СГУ, ауд. 322		
16.15–18.00	Заседание Секции В (председатель: Балаш О. С.)	
	Синявская Т. Г., Маленко В. И.	Статистическая оценка детерминант склонности к финансовому риску
	Чхутиашвили Л. В.	Технический анализ на фондовом рынке России
	Баранов А. Л., Баранова Е. В.	Методологические подходы к оценке функциональных стратегий страховой компании
	Мартынюк Е. А.	Сценарное прогнозирование управления инноватикой АПК
	Коновалова А. В.	Управление рисками инновационного проектирования на различных стадиях жизненного цикла проекта
	Чугунов Д. А.	Влияние страховой секьюритизации на финансовую эффективность деятельности страховщиков

	Казанцева М. Э.	Современные риски в российском пенсионном страховании
	Верещагина Ю. Н.	Подходы и методы к оценке стоимости страховой компании при слиянии и поглощении
	Калитиевская Е. Ю.	Развитие рынка страховых посредников в России
	Мовчан А. В.	Построение иерархической структуры факторов рисков овердрафтного кредитования в банке

7 ноября, четверг

Время	Докладчик	Название доклада
IX корпус СГУ, ауд. 402		
10.00–13.00	Заседание Секции А (председатель: Сидоров С. П.)	
	Нечкина Е. В.	Налоговые риски сельскохозяйственных товаропроизводителей
	Новикова Н. А.	Риски в условиях процессов интеграции предприятий в России
	Тиндова М. Г.	Нечёткие модели в оценке природных ресурсов
	Айриева А. Н.	Методы оценки эффективности финансового стимулирования инвестиционной деятельности с учетом рисков
	Мамаева Л. Н.	Человеческий фактор в управлении риском
	Байбеков И. Р.	Особенности моделирования инвестиционного портфеля коммерческим банком на рынке ценных бумаг
	Колесников А. О.	Стратегия индексного инвестирования как модель формирования портфеля на рынке ценных бумаг
	Гринь Н. В.	Эконометрическое моделирование показателей кредитоспособности на макроуровне
IX корпус СГУ, ауд. 322		
10.00–13.00	Заседание Секции В (председатель: Ермасов С. В.)	
	Батракова Л. Г.	Возможности моделирования в экономике знаний

	Милек О. В., Шмерлинг Д. С.	Фундаментальные основы распределительных механизмов в обществе: демонстрация модели репараметризации неравенства на распределении Парето
	Кашипова И. Р., Сафуанов Р. М.	Математический инструментарий обоснования нормативного соотношения средств кредитных потребительских кооперативов
	Новопольцев А. Ю., Малюгин В. И.	Статистический анализ кредитоспособности в условиях скрытой марковской зависимости рейтингов
	Донецкова О. Ю.	Моделирование в системе управления банковскими рисками
	Говако И. Б.	Прогнозирование ВРП: новые методические подходы (на примере Башкортостана)
	Дыбань А. Л., Стэцюк Т. И.	Государственное регулирование банковской и страховой деятельности
	Зенкова Ж. Н.	Оценка математического ожидания по дважды справа цензурированным данным и ее применение в задаче ценообразования
	Трегубова А. А.	Формирование региональных тарифов в личном страховании: возможности применения поправочных коэффициентов
	Иргалина З. Ф.	Формирование опыта математического моделирования у специалистов страхового дела
13.00–14.00	Обеденный перерыв	
IX корпус СГУ, ауд. 402		
14.00–15.30	Продолжение пленарных заседаний (председатель: Дудов С. И.)	
	Сидоров С. П.	Stock Volatility Modelling Using an Augmented Garch Model with Jumps
	Балаш В. А.	Применение моделей пространственной авторегрессии к анализу финансовых данных
	Ермасов С. В.	Модели финансирования управления риском
15.30–15.45	Перерыв	

IX корпус СГУ, ауд. 402

15.45–18.00	Заседание Секции А (председатель: Сидоров С. П.)	
	Сударикова И. А.	Роль страхования в управлении предпринимательскими и финансовыми рисками
	Волосович С. В.	Моделирование развития страхования рисков кредитной сферы
	Выгодчикова И. Ю.	О моделировании риска с использованием многозначных ценовых данных
	Кучер Н. А.	Модели стохастической волатильности. Оценка параметров моделей стохастической волатильности в среде OpenBUGS
	Lucas Cormac	Genetic Algorithm Solution Approach to Cardinality Constrained Problems
	Узенцова Н. С.	О равномерном приближении алгебраических многочленов нейронными сетями прямого распространения сигнала с одним скрытым слоем
	Гусятников С. В.	Моделирование риска дефолта физического лица
	Погосян А. А.	Особенности информационного риска в России
	Данилов С. А.	Экономический риск: аспекты восприятия
	Усова М. В.	Риски управления общественными связями в информационном обществе
	Федорова А. В.	Организационные риски и методология Пьера Бурдые
	Аникин Д. А.	Риски социальной памяти в трансформирующемся обществе
	Кириллов К. В.	Анализ деятельности банка с помощью факторного анализа

IX корпус СГУ, ауд. 322

15.45–18.00	Заседание Секции В (председатель: Ермасов С. В.)	
	Батракова Л. Г., Колпакова А. Г.	Моделирование склонности населения к организованным сбережениям в банковской системе
	Семернина Ю. В., Якунина А. В.	Риски участников рынка облигаций
	Залетов А. Н.	Бренд страховщика в рефлексивной модели управления

	Подольная Н. Н.	Региональные аспекты информационного обеспечения исследования институционального риска в экономической сфере
	Верезубова Т. А.	Построение теоретической модели оптимизации финансовой стратегии страховой организации
	Поликарпова М. Г.	Математическое моделирование в управлении рисками внешнеэкономической деятельности металлургической компании
	Мухамадиева Э. Ф., Кашипова И. Р.	Моделирование сбалансированности ресурсной и функциональной компонент системы обязательного социального страхования
	Конаков Д. Н.	Общество риска: теоретический экскурс
	Володичева М. О.	Финансовые риски и страховой бизнес. Модели и методы оценки
	Вериго А. В.	Исследование показателей, оказывающих влияние на формирование убыточности страховой суммы
	Долбина С. В.	Статистическое моделирование детерминант выбора индивидом пенсионной стратегии

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

Сайт: <http://ri.sgu.ru/>