

Саратовский национальный исследовательский государственный университет им. Н. Г. Чернышевского

Центральный банк Российской Федерации

НИУ «Высшая школа экономики»



V Международная молодежная научно-практическая конференция

«Математическое и компьютерное моделирование в экономике, страховании и управлении рисками»

V International Youth Research and Practice Conference

“Mathematical and Computer Modelling in Economics, Insurance and Risk Management”

The Workshop on Computer Modelling in Decision Making

Программа Program

Саратов, 9–12 ноября 2016 г.

Saratov, November 9–12, 2016

risk2016.sgu.ru

Оргкомитет конференции

Чумаченко Алексей Николаевич, доктор геогр. наук, ректор СГУ
(*председатель*);

Мхитарян Владимир Сергеевич, доктор экон. наук, профессор, зав. Департаментом статистики и анализа данных НИУ «Высшая школа экономики» (г. Москва) (*зам. председателя*);

Бирюкова Екатерина Ариевна, глава Отделения по Саратовской области Волго-Вятского главного управления Центрального банка Российской Федерации, канд. экон. наук (*зам. председателя*);

Арженовский Сергей Валентинович, доктор экон. наук, профессор РГЭУ (РИНХ) (г. Ростов);

Афанасьев Владимир Николаевич, доктор экон. наук, профессор, зав. кафедрой статистики и эконометрики ОГУ (г. Оренбург);

Абрахам Алтонаян, профессор (Великобритания, г. Лондон);

Аудзеева Алёна, (Великобритания, г. Киль);

Захаров Андрей Михайлович, кандидат физ.-мат. наук, доцент, декан механико-математического факультета СГУ;

Балаш Владимир Алексеевич, доктор экон. наук, профессор кафедры математической экономики СГУ;

Балаш Ольга Сергеевна, кандидат экон. наук, доцент, декан экономического факультета СГУ;

Богачкова Людмила Юрьевна, доктор экон. наук, профессор, зав. кафедрой математических методов и информатики в экономике ВолГУ (г. Волгоград);

Дудов Сергей Иванович, доктор физ.-мат. наук, профессор, зав. кафедрой математической экономики СГУ;

Коломак Евгения Анатольевна, доктор экон. наук, профессор, зав. сектором межрегиональных народнохозяйственных проблем Института экономики и организации промышленного производства СО РАН (г. Новосибирск);

Париш Дате, профессор (Великобритания, г. Лондон);

Фёдорова Антонина Гавриловна, кандидат физ.-мат. наук, доцент, декан факультета компьютерных наук и информационных технологий СГУ;

Дьяченко Михаил Иванович, доктор физ.-мат. наук, профессор кафедры ТФиФА механико-математического факультета МГУ (г. Москва);

Сидоров Сергей Петрович, доктор физ.-мат. наук, руководитель Института рисков СГУ (*секретарь*).

Organizing Committee

Aleksey N. Chumachenko, Rector of SSU, Doctor of Geographical Sciences
(*the Chairman*);

Vladimir S. Mkhitarian, Doctor of Economics, Professor, Head of School of Statistics, Data Analysis and Demography of Higher School of Economics (Moscow)
(*Deputy Chairman*);

Ekaterina A. Birukova, Head of the Saratov Branch of the Volgo-Vyatskiy department of the Russian Central Bank (*Deputy Chairman*);

Vladimir N. Afanasyev, Doctor of Economics, Professor, Head of the Chair of Statistics and Econometrics of OSU (Orenburg);

Abraham Altonayan, Professor (Brunel University, UK);

Sergey V. Arzhenovsky, Doctor of Economics, Professor of RSUE (Rostov);

Alena. Audzeeva, (Keele University, UK);

Olga S. Balash, Candidate of Economics, Associate professor, Dean of SSU Economics Department;

Vladimir A. Balash, Doctor of Economics, Professor of Mathematical Economics Chair of SSU;

Lyudmila Yu. Bogachkova, Doctor of Economics, Professor, Head of the Chair of Mathematical Methods and Informatics in Economy of VolSU (Volgograd);

Parish Date, Professor (London, UK);

Sergey I. Dudov, Doctor of Physics and Mathematics, Professor, Head of Mathematical Economics Chair of SSU;

Evgeniya A. Kolomak, Doctor of Economics, Professor, Sector of inter-regional National Economic Problems Head of FSBIS Institute of Economics and Industrial Engineering of Siberian Branch of the RAS (Novosibirsk);

Andrey M. Zakharov, Candidate of Physics and Mathematics, Associate professor, Dean of Physics and Mathematics Department of SSU;

Antonina G. Fedorova, Candidate of Physics and Mathematics., Associate Professor, Dean of the Department of Computer Sciences;

Mikhail I. Dyachenko, Professor of the TFiFA Department of the Mathematics and Mechanics Faculty of Moscow State University;

Sergey P. Sidorov, Doctor of Physics and Mathematics, Head of SSU Institute of Risks (Saratov) (*Secretary*).

График проведения конференции

9 ноября, среда

09.00–17.00 Регистрация участников

10 ноября, четверг

09.30–10.00 Регистрация участников

10.00–10.10 Торжественное открытие

10.10–13.00 Пленарное заседание

13.00–14.00 Обеденный перерыв

14.00–16.00 Заседание секций

16.00–16.15 Перерыв

16.15–18.00 Заседание секций

11 ноября, пятница

09.00–11.00 Пленарное заседание

11.00–11.30 Перерыв

11.30–13.00 Заседание секций

13.00–14.00 Обеденный перерыв

14.00–15.30 Панельная дискуссия

15.30–15.45 Перерыв

15.45–18.00 Заседание секций

12 ноября, суббота

09.00–17.00 Отъезд участников

Места и время заседаний

Дата \ Аудитория	X корпус СГУ, ауд. 503	IX корпус СГУ, ауд. 404	IX корпус СГУ, ауд. 412	IX корпус СГУ, ауд. 322
9 ноября				09.00–17.00
10 ноября	09.00–16.00	16.15–18.00		14.00–18.00
11 ноября	09.00–15.30	11.30–18.00	15.45–18.00	11.30–18.00
12 ноября				09.00–17.00

Conference Schedule

November 9, Wednesday

09.00–17.00 Registration

November 10, Thursday

09.30–10.00 Registration

10.00–10.30 Opening ceremony

10.30–13.00 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 11, Friday

09.00–11.00 Plenary presentations

11.00–11.30 Break

11.30–13.00 Section presentations

13.00–14.00 Lunch break

14.00–15.30 Panel discussion

15.30–15.45 Break

15.45–18.00 Section presentations

November 12, Saturday

09.00–17.00 Departure

Place and time

Date \ Room	X bld. of SSU, room 503	IX bld. of SSU, room 404	IX bld. of SSU, room 412	IX bld. of SSU, room 322
November 9				09.00–17.00
November 10	09.00–16.00	16.15–18.00		14.00–18.00
November 11	09.00–15.30	11.30–18.00	15.45–18.00	11.30–18.00
November 12				09.00–17.00

Программа конференции

10 ноября, четверг

Время	Докладчик	Название доклада
Х корпус СГУ, ауд. 503		
09.30–10.00	Регистрация участников	
10.00–10.10	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	
10.10–13.00	Пленарное заседание (председатель: Мхитарян В. С.)	
	Хаметов В. М.	Биномиальная байесовская модель бескупонной облигации
	Якунина А. В.	Российский «бермудский треугольник»: анализ рисков газовой отрасли
	Белкина Т. А.	Insurer's solvency and risky investments: optimal policies in a dynamic setting
	Савватеев А. В.	Brexit на языке математики: игры тернарного выбора на графах
13.00–14.00	Обеденный перерыв	
Х корпус СГУ, ауд. 503		
14.00–16.00	The Workshop on Computer Modelling in Decision Making. Part I (председатель: Савватеев А. В.)	
	Alexey Faizliev, Sergei Sidorov, Sergei Mironov, Andrey Khomchenko	Empirical Analysis of Index Tracking Error Minimization Algorithms Based on Stochastic Dominance
	Tatiana Belkina, Nadezhda Konyukhova, Bohdan Slavko	Survival Probability in the Life Annuity Insurance Model with Stochastic Return on Investments

	Vladimir Khametov, Elena Shelemekh, Evgeniy Yasonov	Solving Optimal Stopping Problem by Using Computer Algebra Systems
	Nina Grishina	Model of Risk-Oriented Management in Governmental Institutions: Process Approach
	Yulia Semernina, Alla Yakunina, Ekaterina Nesterenko, Sergey Yakunin, Evgeny Korobov	Improving the Tools Used in Computer Modelling the Bond Liquidity Assessment on the Russian Market

IX корпус СГУ, ауд. 322

14.00–16.00	Секция «Моделирование рисков экономических систем» (председатель: Файзлиев А. Р.)	
	Балабан О. М., Лучин М. А., Орлов Ю. М.	Исследование и прогнозирование поведения биржевых индексов с использованием методов статистического анализа в табличном процессоре MS Excel
	Бойко А. А., Пилюгина А. В.	Определение оптимального временного ряда для прогнозирования валютного курса с использованием нечеткой логики
	Быкова А. А., Иванова А. Д.	Краткосрочное прогнозирование доходности агрессивного индекса пенсионных накоплений (ruраi) по Винеру и Байесу
	Выгодчикова И. Ю.	О методе аппроксимации двузначного динамического ряда: оптовая и розничная цена.
	Магомедова Е. С., Панахов В. С.	Статистические методы прогнозирования экономических показателей.
	Новиков А. И., Солодкая Т. И.	Компьютерные технологии формирования инвестиционных портфелей
	Реннер А. Г., Стебунова О. И., Погорелова П. В.	Математические модели формирования страховых тарифов (на примере имущественного страхования)

	Шелемех Е. А.	Расчет экзотических опционов на неполном рынке, заданном марковской цепью с конечным числом состояний
	Tindova M. G.	Development of tools for processing big data
16.00–16.15	Перерыв	
IX корпус СГУ, ауд. 404		
16.15–18.00	Секция «Математическое моделирование экономических процессов» (председатель: Дудов С. И.)	
	Киндаев А. Ю., Моисеев А. В.	Взаимосвязи при выращивании сельскохозяйственных культур в отдельных субъектах Приволжского федерального округа.
	Сидоров С. П., Файзлиев А. Р., Барабаш В. А., Луныков А. Д.	Анализ средствами квантильной регрессии современных рисков российских компаний
	Выгодчикова И. Ю., Акимова С. К.	О доле в распределении инновационных инвестиций на базе минимаксной модели
	Выгодчикова И. Ю., Тряпкина Т. С.	Анализ размещения информации о товарном ассортименте Интернет-магазина на сайте с использованием минимаксного подхода
	Харламов А. В.	Анализ динамики моделей ценообразования
	Выгодчикова И. Ю., Сатубалдиева Д. А., Шевченко Э. А.	Об иерархическом подходе к моделированию денежных накоплений индивида.
	Vygodchikova I. Yu.	Modeling multivalued dynamic series of financial indexes on the basis of minimax approximation in the hausdorff metric with the constraint
	Луныков А. Д.	Динамические пространственные модели для панельных данных на рынке жилья

IX корпус СГУ, ауд. 322

16.15–18.00	Секция «Моделирование рисков экономических систем» (председатель: Сидоров С. П.)	
	Григорьева А. А.	Проектирование моделей архитектурных решений импортоориентированных торговых компаний с применением стандартов TOGAF
	Гуров Н. В., Зенкова Ж. Н.	Робастная оценка среднего в анализе оборачиваемости оборотных средств предприятия
	Даммер Д. Д.	Исследование общей суммы единовременных страховых выплат в модели с ограниченным страховым полем
	Агеева И. Е. Фирсова А. А.	Методики оценки кредитоспособности заёмщиков как инструмент снижения кредитного риска коммерческого банка
	Айриева А. Н., Зотова Э. В.	Развитие потребительского кредитования за счет совершенствования систем кредит-скоринга коммерческих банков
	Воронина А. Д., Давыдова М. С., Корнилова О. Ю.	Особенности инвестиционной политики страховых организаций в России и зарубежом
	Карелина М. Г.	Эконометрический подход к моделированию стоимостного объема рынка слияний и поглощений
	Каширцева А. П.	Расчет бортового содержания при подготовке технико-экономических обоснований отработки золоторудных месторождений
	Коробов Е. А.	Риски сырьевой модели роста российской экономики
	Коротковская Е. В.	Финансирование инноваций: типы, основные характеристики и риски
	Коротковская Е. С., Смолов Ф. М.	Интернет-реклама: особенности, цели и риски

	Котар О. К., Носов В. В.	Моделирование оптимальной величины региональной бюджетной поддержки сельскохозяйственного страхования
--	-----------------------------	---

11 ноября, пятница

Время	Докладчик	Название доклада
Х корпус СГУ, ауд. 503		
09.00–11.00	Пленарное заседание (председатель: Хаметов В. М.)	
	Балаш В. А., Сидоров С. П., Файзлиев А. Р.	Анализ фрактальной структуры временных рядов интенсивности новостного потока
	Копнова Е. Д., Родионова Л. А.	Эконометрическое моделирование и анализ детерминант продовольственной безопасности
	Мхитарян В. С.	Статистическое исследование интеграционной активности российских холдингов
	Киселев М. В.	Моделирование и прогнозирование на финансовых рынках - возможности и ограничения
	Истомина Н. А.	Роль математического моделирования в развитии бюджетного планирования на уровне субъектов Российской Федерации
11.00–11.30	Перерыв	
Х корпус СГУ, ауд. 503		
11.30–13.00	Секция «Финансовые аспекты управления рисками в экономике» (председатель: Балаш В. А.)	
	Renner A. G., Yarkova O. N., Pivovarova Ch. V.	Approaches to modeling capital of commercial banks in the dynamics
	Харин И. А.	Подходы к моделированию влияния неэкономических факторов на доходы бюджетов
	Сенокосова О. В.	Риски электронного рынка труда

	Хомченко А. А., Сидоров С. П., Мионов С. В.	Оптимальный портфель для инвестора с асимметричным отношением к прибылям и потерям
--	---	--

IX корпус СГУ, ауд. 322

11.30–13.00	The Workshop on Computer Modelling in Decision Making. Part II (председатель: Кабанцева Н. Г.)	
	Anatoly V. Panyukov, Ekaterina N. Kozina	Forming of competitive enterprise investment programs
	Ekaterina Orlova	Modeling and Decision Support for the Firms' Pricing Policy under a Chaotic Dynamic of Market Prices
	Vladimir Mkhitarian, Mariia Karelina	Econometric Modeling of the Dynamics of the Integration Activity of Russian Companies
	Vladimir Mkhitarian, Svetlana Mikhaylova	Econometric Modeling of the Parameters Actuarial Model of Net Rates for Life Insurance of the Population of Region
	Luidmila Bilgaeva	Formation of Life Quality Indicators System through Search Algorithm of Association Rules

IX корпус СГУ, ауд. 404

11.30–13.00	Секция «Финансовые аспекты управления рисками в экономике и страховании» (председатель: Файзлиев А. Р.)	
	Ермакова Е. А.	Бюджетный риск как следствие неэффективного использования бюджетных средств
	Гильдеева Я. Р.	Классические методы управления финансовыми рисками в системе государственных закупок
	Горбачева А. С.	Понятие сельскохозяйственного страхования с государственной поддержкой
	Горбунов В. К.	Экономическая теория и наука
	Гришина Н. П.	Риск-ориентированное управление
	Акобян Р. Г.	Перспективы развития страхования грузов в Республике Армения

	Васильева Т. А., Жолобов С. С.	Исследование влияния «греков» на стоимость финансовых опционов
	Дерунов В. А., Темякова Т. В.	Методические подходы к оценке устойчивости социально-экономического развития региона
	Дерунова Е. А., Устинова Н. В.	Оценка влияния инновационного кластера на конкурентоспособность региона
	Дерунова Е. А., Семенов А. С.	К вопросу управления экономикой в условиях «голландской болезни»
	Ермасов С. В.	Проблемы развития российского риск-менеджмента.
13.00–14.00	Обеденный перерыв	
Х корпус СГУ, ауд. 503		
14.00–15.30	Панельная дискуссия «Государство, стратегия, риски: новая нормальность» (модератор: Гришина Н. П.)	
	Швакова Ю. А., министр экономического развития Саратовской области	
	Разборов А. А., председатель комитета по экономике администрации муниципального образования «Город Саратов»	
	Струков А. С., и.о. председателя комитета по финансам администрации муниципального образования «Город Саратов»	
	Данилов М. В., заместитель председателя комитета по финансам администрации муниципального образования «Город Саратов»	
15.30–15.45	Перерыв	
IX корпус СГУ, ауд. 404		
15.45–18.00	Секция «Компьютерное моделирование экономических процессов» (председатель: Терёхин П. А.)	
	Кондратьева Е. В., Никонова Е. Н., Кондратьева О. Ю., Терин Д. В.	Нечеткие приоритетные алгоритмы планирования в распределенных вычислительных системах
	Ломовцева К. С., Тугушева Г. Р.	Планирование оптимальной длительности гарантийного срока службы изделий машиностроения на основе теории ассиметричных копул

	Степанова О. М., Степанов М. Ф.	О задаче выбора в условиях неполноты информации
	Шаталина А. В., Мухортова Н. А.	Расчёт справедливой цены опциона, портфеля и капитала
	Шаталина А. В., Родионова Е. М.	Создание с помощью опционов безрисковых портфелей
	Беличенко К. В., Соболев В. М.	Учет рабочего времени сотрудников с помощью технологий RFID
	Василенко М. А.	Методика расчёта страховых тарифов
	Глаголев А. И., Шебалдин В. Р.	Численное решение задачи оптимального роста предприятия односекторной экономики
	Голышкин Н. И., Шебалдин В. Р.	О необходимых условиях оптимальности управления в одной задаче экономического роста предприятия односекторной экономики с бесконечным горизонтом управления
	Гудков А. А.	Использование жадных алгоритмов для нахождения регрессии с условием монотонности
	Дрозденко Е. А.	Решение задачи о замене оборудования с помощью теории цепей Маркова с доходами
	Зайцев Н. Н.	Анализ модели ценообразования на рынке недвижимости
	Моругова А. В.	О некоторых методах анализа временных рядов в экономике
	Сысуева С. Д.	Анализ эффективности применения стратегии Каги при случайном блуждании цены актива

IX корпус СГУ, ауд. 412

15.45–18.00	Секция «Математическое моделирование экономических процессов» (председатель: Балаш В. А.)	
	Митрофанов А. Ю.	Эконометрические модели зависимостей обменных курсов иностранных валют от цен на нефть

	Камышова Г. Н., Дудов С. И.	Вычислительные эксперименты по прогнозированию цен на зерновом рынке
	Макаров А. В., Макеева Ю. А., Дудов С. И.	О подходе к прогнозированию экономического процесса по параметрам, заданным сегментными функциями
	Малярова М. В.	Нейронные сети как инструмент моделирования прогноза валютной котировки на фондовой бирже
	Файзлиев А. Р., Хусаинов Р. Ф.	Анализ временных рядов новостной интенсивности российских компаний
	Шебалдин В. Р.	Необходимые условия экстремума в одной задаче экономического роста
	Асташина А. М.	Исследование эффективности ИСМ, как элемента оценки и планирования бизнес-рисков
	Андреева А. С.	Анализ эффективных процентных ставок по векселям
	Горина И. А.	Алгоритм Франка-Вульфа для решения задачи оптимального портфельного инвестирования
	Долговская Ю. А.	Автоматизированная торговля на базе торговой площадки MetaTrader 4
	Сафиуллина С. В.	Торговые индикаторы для советников в MetaTrader 4
	Королькова Н. А.	Проблемы внедрения информационных систем в бухгалтерском учете
	Утарова Т. В.	О структуре инновационных инвестиций

IX корпус СГУ, ауд. 322

15.45–18.00	Секция «Финансовые аспекты управления рисками в экономике и страховании» (председатель: Погодина А. Ю.)	
	Завидовский Р. А.	К вопросу об организации финансовых отношений в страховании
	Закирова О. В., Шульгина М. В.	Анализ методов оценки регионального инвестиционного потенциала

	Панюков А. В., Фокина М. С.	Математический анализ и синтез управления производственной деятельностью горнодобывающего предприятия
	Челнокова О. Ю.	Модели трансфера технологий в инновационном развитии экономики
	Синявская Т. Г., Трегубова А. А.	Подходы к статистической дооценке риска в личном страховании
	Скрипкина Н. В.	Риски мошенничества в автостраховании: принципы формирования информационной базы данных внешних инцидентов
	Смагина О. В.	Анализ финансовой отчётности как основа работы предприятия
	Терников А. А.	Методы сбора и анализа данных при прогнозировании стоимости квадратного метра на рынке недвижимости
	Трифонов Б. И.	Big data в страховании: новые технологии оценки рисков
	Филатова И. Н., Сычева В. О.	Маркетинговая политика по продвижению высокотехнологичной продукции
	Фирсова А. А., Кириллов Р. А., Кириллова О. Ю., Вавилина А. В.	Моделирование процесса контроля регуляторных рисков банка
	Фирстова М. Ю.	Анализ экологических рисков на нефтеперерабатывающем производстве

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/>

Сайт конференции: <http://risk2016.sgu.ru/>