

Саратовский государственный университет им. Н. Г. Чернышевского
Центральный банк Российской Федерации
Высшая школа экономики



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

III International Youth Research and Practice Conference
“**MATHEMATICAL MODELLING IN ECONOMICS
AND RISK MANAGEMENT**”

Программа Program

Саратов, 5–8 ноября 2014 г.
Saratov, November 5–8, 2014

risk2014.sgu.ru

Оргкомитет конференции

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

Зеленский Юрий Борисович, начальник Главного управления ЦБ РФ по Саратовской области (*зам. председателя*);

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

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;

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

Семенычев Валерий Константинович, доктор экон. наук, профессор, ректор САГМУ (г. Самара);

Сидоров Сергей Петрович, кандидат физ.-мат. наук, доцент 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*);

Yury B. Zelensky, Head of the Main Branch of the Central Bank of the Russian
Federation for Saratov region (*Deputy Chairman*);

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

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

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 VoISU (Volgograd);

Parish Date, Professor (London, UK);

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

Valeriy K. Semenychev, Doctor of Economics, Professor, Rector of SASMM
(Samara);

Sergey P. Sidorov, Candidate of Physics and Mathematics, Associate professor of
SSU (*Secretary*).

График проведения конференции

5 ноября, среда

09.00–17.00 Регистрация участников

6 ноября, четверг

09.30–10.00 Регистрация участников
10.00–10.30 Торжественное открытие
10.30–13.00 Пленарные заседания
13.00–14.00 Обеденный перерыв
14.00–16.00 Заседание секций
16.00–16.15 Кофе-брейк
16.15–18.00 Заседание секций

7 ноября, пятница

10.00–13.00 Заседание секций
13.00–14.00 Обеденный перерыв
14.00–16.00 Заседание секций
16.00–16.15 Кофе-брейк
16.15–18.00 Заседание секций

8 ноября, суббота

9.00–17.00 Отъезд участников

Места и время заседаний

Аудитория Дата	IX корпус СГУ, ауд. 401	IX корпус СГУ, ауд. 402	IX корпус СГУ, ауд. 322
5 ноября			09.00–17.00
6 ноября	09.00–16.00	16.00–18.00	14.00–18.00
7 ноября		10.00–18.00	10.00–16.00
8 ноября			09.00–17.00

Conference Schedule

November 5, Wednesday

09.00–17.00 Registration

November 6, 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 Coffee-break

16.15–18.00 Section presentations

November 7, Friday

10.00–13.00 Section presentations

13.00–14.00 Lunch break

14.00–16.00 Section presentations

16.00–16.15 Coffee-break

16.15–18.00 Section presentations

November 8, Saturday

9.00–17.00 Departure

Time and Place of Sessions

Date \ Room	Room	IX build. of SSU, room 401	IX build. of SSU, room 402	IX build. of SSU, room 322
November 5				09.00–17.00
November 6		09.00–16.00	16.00–18.00	14.00–18.00
November 7			10.00–18.00	10.00–16.00
November 8				09.00–17.00

Программа конференции

6 ноября, четверг

Время	Докладчик	Название доклада
IX корпус СГУ, ауд. 401		
09.30–10.00	Регистрация участников	
10.00–10.30	Торжественное открытие конференции	
	Мхитарян В. С.	Приветствие участникам
	Чумаченко А. Н.	Приветствие участникам
	Зеленский Ю. Б.	Приветствие участникам
10.30–13.00	Пленарное заседание (председатель: Мхитарян В. С.)	
	Балаш В. А.	Сравнение точности прогнозирования некоторых моделей временной структуры процентных ставок
	Носов В. В.	Моделирование тенденции площади застрахованных сельскохозяйственных культур
	Сидоров С. П.	Некоторые эмпирические результаты для дополненной GARCH-модели с прыжками
	Фирсова А. А.	Моделирование влияния университета на инновационное развитие региона
13.00–14.00	Обеденный перерыв	
IX корпус СГУ, ауд. 401		
14.00–16.00	Секция «Практика управления рисками в банковском деле» (председатель: Островская Е. А.)	
	Травкина Е. В.	Необходимость проведения мониторинга банковских рисков и его значение для развития экономики страны
	Бирюкова Е. А., Мамонтов Д. С., Файфель Б. Л.	Перспективы создания системы оценки и управления рисками в Банке России
	Кондрашов В. А.	Управление риском инноваций в коммерческом банке
	Суслов М. А.	Корпоративные риски. Виды. Выявление. Хеджирование
	Хапров В. Г.	Особенности оценки рисков при кредитовании факторинговых компаний

	Каргальцева А. А.	Система управления операционными рисками на примере саратовского филиала ОАО «Россельхозбанк»
	Куликов И. В.	Критерии оценки влияния личности руководителя предприятия-клиента на различные виды банковских рисков
	Юнусова А. А.	Классификация банковских рисков по основным видам

IX корпус СГУ, ауд. 322

14.00–16.00	Секция «Управление рисками экономических систем» (председатель: Балаш О. С.)	
	Каширцева А. П., Пилюгина А. В.	Построение системы экономико-математического управления финансовыми результатами предприятий строительной отрасли
	Филатова И. Н., Дерунов В. А.	Механизм управления взаимодействием между производителем и потребителем в области сбыта высокотехнологичной продукции
	Жарникова Е. Ю.	Риск кредитного продукта коммерческого банка: определение и формализация
	Азиз Х. С.	Сравнительный анализ стран ОПЕК по уровню развития экономики
	Ермакова Е. А.	Бюджетно-налоговые риски консолидации налогоплательщиков
	Иванова А. С.	Региональная система поддержки развития малого предпринимательства как фактор снижения налоговых, инвестиционных и кредитных рисков
	Магомедова Е. С., Гаджиева М. О.	Моделирование качества жизни населения на основе исследования индекса развития человеческого потенциала (ИРЧП)
	Грибова Е. В.	Экономико-математическое моделирование категории общественного благосостояния
	Пузаков А. В.	Анализ и прогнозирование динамики производства мяса в России
16.00–16.15	Кофе-брейк	

IX корпус СГУ, ауд. 402

14.00–18.00	Секция «Математическое моделирование экономических рисков» (председатель: Дудов С. И.)	
	Выгодчикова И. Ю.	О минимаксном моделировании оценки риска финансового портфеля

	Харламов А. В., Лысункина Ю. В.	Статистический анализ рисков адаптации студентов первокурсников к системе образования в высшей школе
	Ануфриев А. А., Дудов С. И.	Индикатор экономического процесса на основе приближения сегментной функции обобщенным полиномом
	Железнова А. А., Дудов С. И.	О снижении технологических рисков центрированием области работоспособности проектируемого устройства
	Макаров А. В., Дудов С. И.	Разработка индикатора на основе приближения траектории цен и объема торгов
	Выгодчикова И. Ю., Ныrkова М. А.	О моделировании оптимального контракта «агент-принципал» при распределении рабочего времени
	Выгодчикова И. Ю., Фадина Т. В., Вязьминская А. В.	О математическом моделировании пенсионных процессов
	Бойцов Д. И., Сидоров С. П.	Алгоритмы формосохраняющего динамического программирования для решения задачи оптимального роста
	Сидоров С. П., Хомченко А. А., Барабаш В. А.	Простая стохастическая модель портфельной оптимизации в рамках теории перспектив
IX корпус СГУ, ауд. 322		
16.15–18.00	Секция «Управление рисками экономических систем» (председатель: Ермасов С. В.)	
	Ермасов С. В.	Многоканальное финансирование интегрального риска инновационной организации
	Медведев Б. А.	Изучение основных подходов к измерению кредитных рисков потребительского кредитования
	Бакуменко Л. П., Вырыпаева Н. В.	Модель оценки риска дефолта предприятий республики Марий Эл
	Митрофанов В. И.	Вопросы моделирования динамики российских фондовых индексов
	Семернина Ю. В., Якунина А. В.	Математическое моделирование доходности и оценка риска эмитента корпоративных облигаций
	Нестеренко Е. А., Челпанова В. А.	Оценка риска паевых инвестиционных фондов
	Солодкая Т. И., Мавзовин В. С.	Математическое моделирование риска и эффективности в экономике

	Апухтин П. А.	Прогнозирование добычи угля в России с учётом рисков мирового рынка
	Цыпин А. П.	Моделирование показателей работы железнодорожного транспорта РФ
	Ипатова И. Б.	Факторы технической эффективности и отдача от масштаба в отрасли производства пластмассовых изделий

7 ноября, пятница

Время	Докладчик	Название доклада
IX корпус СГУ, ауд. 402		
10.00–13.00	Секция «Управление рисками в страховании» (председатель: Носов В. В.)	
	Сударикова И. А.	Страхование финансовых рисков: современная практика и тенденции развития
	Балаш В. А., Балаш О. С.	Пространственный анализ темпов роста региональных страховых рынков
	Иванова В. П.	О проблемах математического моделирования процесса обеспечения ветеринарной безопасности России
	Котар О. К., Носов В. В.	Типологизация субъектов РФ по состоянию сельскохозяйственного страхования с государственной поддержкой
	Сенокосова О. В.	Риски в экономическом пространстве рынка труда
	Игбаева Г. Р., Шакирова З. Р.	Новеллы правового регулирования управления рисками в сфере обязательного страхования гражданской ответственности владельцев транспортных средств
	Моисеев А. В., Киндаев А. Ю.	Генерация многомерной случайной величины для моделирования страхования аграрных рисков
	Фёдорова А. Г., Шишов В. Ф.	Определение оптимального количества жилья для лиц, пострадавших от пожаров, на основе стохастической модели
	Асанина Д. А., Шишов В. Ф.	Статистический анализ, моделирование и прогнозирование количества городских пожаров в регионе

	Шишов В. Ф., Киндаев А. Ю.	Нейронные сети как альтернативный метод прогнозирования показателей городских пожаров
	Василенко М. А.	Разработка ПП для расчёта страховых тарифов (модель аккумуляции)
IX корпус СГУ, ауд. 322		
10.00–13.00	Секция «Актуальные проблемы риск-менеджмента в страховом деле» (председатель: Сидоров С. П.)	
	Верезубова Т. А.	Совершенствование методов формирования резервов убытков в страховых организациях
	Ермасов С. В.	Риски страхового финансирования инноваций
	Савиных Л. А., Верещагина Ю. Н.	Андеррайтинг устойчивости страховых операций при слиянии и поглощении на страховом рынке
	Синявская Т. Г., Трегубова А. А.	Возможность корректировки тарифов страхования жизни с учетом регионального риска
	Верещагина Ю. Н.	Тенденции развития страхового рынка под влиянием процесса международной интеграции
	Закирова О. В.	Идентификация рисков как этап андеррайтинга при страховании имущества корпоративных клиентов
	Вавилова И. А.	Формирование инвестиционного портфеля страховой организации
	Ачкасова С. А.	Особенности использования трансфертного ценообразования в страховании
	Белова Л. А.	Карта рисков выхода страховой компании на рынок по туристическому виду страхования
	Азнабаева А. М.	Моделирование влияния социально-экономических факторов на ВВП стран-членов таможенного союза
	Дерунова Е. А., Семенов А. С.	Математическое обоснование влияния роста объема сырьевого сектора на темпы экономического роста
	Щербаков А. А.	Риски облигационного финансирования для эмитентов субфедеральных облигаций
13.00–14.00	Обеденный перерыв	

IX корпус СГУ, ауд. 402

14.00–16.00	Секция «Математическое моделирование экономических рисков» (председатель: Балаш В. А.)	
	Качалов Р. М., Слепцова Ю. А.	Моделирование процедур регулирования экономического риска с применением теории нечетких множеств
	Васильева Т. А., Рыжков А. А.	Численная реализация тринომiальной модели оценивания опционов
	Маркова А. Р.	Применение EGARCH-модели для управления структурой портфеля ценных бумаг
	Барабаш В. А.	Применение статической и динамической моделей меры риска CoVaR в рамках финансово-экономической системы России
	Макарова К. М.	Имитационное моделирование цепочки поставок в AnyLogic
	Романова А. С.	Некоторые подходы к оценке адекватности расчета показателя VaR историческим методом
	Федышин О. Я.	Эконометрические модели прогнозирования отзыва лицензий коммерческих банков
	Файзлиев А. Р., Сидоров С. П., Коробов Е. А.	Алгоритм детрендирования для анализа колебаний данных о новостной интенсивности

IX корпус СГУ, ауд. 322

14.00–16.00	Секция «Математическое моделирование финансовых рисков» (председатель: Арженовский С. В.)	
	Арженовский С. В., Ромашкина В. И.	Математическое моделирование динамики цены и оценка риска инвестиций в золото
	Ковальчук В. А.	Модель оценки эффективности применения кластерного механизма для реализации инвестиционных проектов
	Сакулина О. М.	Статистический анализ дифференциации субъектов РФ по уровню тарифов на услуги жилищно-коммунального хозяйства
	Павлюк Д. В.	Проблема идентификации параметров пространственной модели стохастической производственной границы

	Малюгин В. И., Новопольцев А. Ю.	Анализ циклических изменений финансовых рынков на основе многомерных регрессионных моделей с марковскими переключениями состояний
	Алхамов А. М.	Статистические методы торговли на финансовом рынке
16.00–16.15	Кофе-брейк	
IX корпус СГУ, ауд. 402		
16.15–18.00	Секция «Управление социально-экономическими рисками» (председатель: Хасин В. В.)	
	Коротковская Е. В.	Инвестиционная привлекательность регионов как функция регионального инвестиционного некоммерческого риска
	Данилов С. А.	Доверие и риски современного общества: концептуально-теоретический профиль
	Федорова А. В.	Культура риска: моделирование и определение
	Степанов И. И.	Социальное управление в организации как способ снижения риска социальной напряженности общества
	Гераськина И. Ю.	Автоматизированная информационная система школьного питания
	Тали М. М.	Влияние телекоммуникаций информационных технологий на экономическое развитие стран Ближнего Востока

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://risk2014.sgu.ru/>