

Математическое и компьютерное моделирование в экономике, страховании и управлении рисками – 2018. Программа

(версия программы 2.3)

15 ноября, четверг

Время	Докладчик	Название доклада
Х корпус СГУ, ауд. 503		
09.00–10.00	Регистрация участников	
10.00–10.10	Торжественное открытие конференции	
	Чумаченко А. Н., ректор Саратовского госуниверситета	
	Харламов А. В., зам. управляющего Отделением по Саратовской области Волго-Вятского главного управления Центрального банка РФ	
	Мхитарян В. С., руководитель Департамента статистики и анализа данных НИУ ВШЭ	
10.10–11.50	Пленарное заседание (председатель: Балаш В. А.)	
	Мхитарян В. С.	Учебно-методическое обеспечение образовательного процесса при подготовке студентов-статистиков
	Павлюк Д. В.	Spatiotemporal feature selection for urban traffic flow modelling
	Громова А. О.	Software development risk management: data mining of defect reports
11.50–12.10	Перерыв	
12.10–13.30	Секция «Математические методы анализа макроэкономических процессов» (председатель: Островская Е. А.)	
	Островская Е. А.	О денежно-кредитной политике Банка России и решении Совета директоров Банка России по ключевой ставке 26.10.2018
	Мамонтов Д. С.	Вопросы моделирования инфляции на примере Саратовской области
	Спиридонов К. А.	Оценки разрыва выпуска на региональном уровне
	Якунина А. В., Якунин С. В.	Некоторые аспекты цифровизации кредитного риска

	Гудков А., Сидоров С. П., Тышкевич С. В., Миронов С. В.	Сглаживание временных рядов с использованием k-монотонной регрессии
	Огурцова Е. В.	Оценка влияния макроэкономической конъюнктуры на развитие региональных систем высшего образования
13.30–14.30	Обеденный перерыв	
X корпус СГУ, ауд. 503		
14.30–15.30	The Third Workshop on Computer Modelling in Decision Making (moderator: Sidorov S. P.)	
	Alexander Alekseev, Irina Alekseeva, Alexandra Noskova, Victoriya Kylosova, Alena Knyazeva	New applications of the annual fiscal accounting analysis at the risk assessment
	Elena Rostova, Mihail Geraskin	Optimisation of costs function for prevention of firms' industrial risks with penalties
	Ekaterina Orlova	Approach for Economic Risks Modeling and Anti-risk Decisions Making in a Transport Company
	Vladimir Gorbunov	Theory of Collective Market Demand
15.30–15.45	Перерыв	
15.45–16.45	The Third Workshop on Computer Modelling in Decision Making (moderator: Gorbunov V. K.)	
	Igor Lutoshkin, Nailya Yamaltdinova	The Dynamic Model of Real Investment with Constant and Continuously Distributed Lags
	Varvara Spirina, Alexander Alekseev, Alexandra Andronova	Analysis and forecasting of management decisions in commercial real estate management
	Efrosiniya Karatetskaya, Valeriya Lakshina	Multiple Hedging on Energy Market
	Viacheslav Sirotin, Ksenia Alexeeva	Estimation of Fuzziness for Respondents' Quantitative Data on Income
16.45–17.00	Перерыв	
IX корпус СГУ, ауд. 402		
17.00–19.00	Секция «Математическое моделирование экономических и финансовых рисков» (председатель: Выгодчикова И. Ю.)	
	Васильева Т. А., Жолобов С. С.	Численное решение одного нелинейного уравнения Блэка-Шоулза с переменной волатильностью методом Кранка-Никольсона

	Калашников П. В.	Динамическая модель оценки баланса солидарно-распределительной пенсионной системы в долгосрочном периоде
	Кузнецова М. А.	Свойства дискретных преобразований Фурье по системе мультипликативных функций
	Плотников Г. А., Дудов С. И.	Прогнозирование экономического процесса на основе полиномиального приближения его показателей
	Шаталина А. В., Крылова М. В.	Анализ экзотических опционов
	Выгодчикова И. Ю., Калачев С. О.	Стратегия принятия решения на фондовом рынке с использованием логических правил обработки нескольких торговых сигналов
	Колесников В. А., Сидоров С. П., Файзлиев А. Р.	Нахождение наиболее важных видов животных смешанного леса Нацпарка «Хвалынский»
	Жиц М. Г.	Подход к моделированию демографических процессов при планировании развития пенсионной системы в РФ

IX корпус СГУ, ауд. 322

17.00–19.00	Секция «Эконометрическое моделирование» (председатель: Шебалдин В. Р.)	
	Родионова Л. А., Свиридова В. Ю.	Моделирование уровня преступности на основе моделей коинтеграции
	Гарафутдинов Р. В.	Анализ фрактальных свойств финансовых рынков для целей прогнозирования
	Алибалаева Л. И.	Нейро-нечеткое моделирование в разработке Стратегии регионального развития
	Кондратьева Е. В., Кондратьева О. Ю.	Алгоритм снижения финансовых рисков при участии в инновационных проектах
	Каширцева А. П.	Роль производственной мощности золотодобывающего предприятия при моделировании годовой операцион. прибыли
	Степанова О. М., Степанов М. Ф.	Исследование условий управляемости динамич. систем при внешних воздействиях
	Борисова Л. В., Князева М. А.	Влияние рискованной надбавки на формирование страхового портфеля
	Хоминич И. П., Перепелица Д. Г., Пискарев Д. М.	Нейтрализация и анализ корреляций как методы статистического арбитража на фондовом рынке

	Харламов А. В.	Применение пространственного коэффициента при прогнозировании по геокодированным данным
IX корпус СГУ, ауд. 320		
17.00–19.00	Секция «Модели оценки рисков» (председатель: Тышкевич С. В.)	
	Маслова Л. А.	Кредитный скоринг. Методы построения скоринговых моделей
	Бакуменко Л. П., Сосков В. О.	Перераспределение рисков при инвестировании в криптовалюты
	Синявская Т. Г. Трегубова А. А.	Модели бинарного отклика и порядковой регрессии в исследовании страхового поведения
	Кондратьева Е. В., Кондратьева О. Ю.	Анализ эффективности прогнозирования успеваемости на основе FUZZY LOGIC
	Кирич И. Е.	Вероятностный подход к прогнозированию спроса на товары электронной коммерции
	Ахуньянова С. А.	Прогнозирование динамики цены криптовалюты на основе специализир. Р-адического метода
	Тренина М. А., Давыдова Е. В.	Применение метрики на перестановках в алгоритмах решения задач дискретной оптимизации
	Кондратьева Е. В.	Использование жадных алгоритмов для решения некоторых задач оптимизации
	Ляльков И. М., Хоминич И. П.	Сравнительный анализ моделей волатильности рынка нефти

16 ноября, пятница

Время	Докладчик	Название доклада
X корпус СГУ, ауд. 503		
10.00–11.50	Пленарное заседание (председатель: Мхитарян В. С.)	
	Лукашов А. Л.	Многомерные B-сплайны и их применения в вычислительной математике и страховании
	Орлова Е. В.	Модели и механизмы согласованного управления производственно-экономической системой
	Файзлиев А. Р., Балаш В. А., Сидоров С. П.	Моделирование реакции финансового рынка на события, маркированные по данным новостной аналитики

	Сарычева Т. В.	Статистический анализ занятости по видам экономической деятельности и ее эффективности
11.50–12.10	Перерыв	
12.10–13.30	Секция «Риски финансовых рынков» (председатель: Гераськин М. И.)	
	Родионов Г. Р.	Конкуренция в новой эпохе IFRS 9
	Спирина В. С., Алексеев А. О., Андропова А. А.	Прогнозирование результатов принимаемых решений в управлении коммерческой недвижимостью
	Алексеева И. Е., Носкова А. Р., Кылосова В. В., Князева А. И.	Новые приложения задачи оценки рисков на основе анализа бухгалтерской отчетности
	Мясников А. А.	Анализ данных в управлении рисками факторинга
	Безруков А. И., Граховская Л. В.	Оценка риска несоответствия спроса и предложения на рынке квалифицированного труда
13.30–14.30	Обеденный перерыв	
Х корпус СГУ, ауд. 503		
14.30–15.45	The Third Workshop on Computer Modelling in Decision Making (moderator: Alekseev A. O.)	
	Mikhail Geraskin	The simulation of oligopoly information equilibria with agents' capacity constraints
	Sergei Mironov, Alexey Faizliev, Roman Glazov, Mikhail Levshunov, Tatiana Tryapkina, Ivan Androsov, Vladimir Petrov	Preliminary Analysis of the Evolution of Market Graph Characteristics
	Anna Firsova, Galina Chernyshova	Modeling of Regional High Education Systems' Efficiency by Data Envelopment Analysis
	Alla Yakunina, Sergey Varygin, Ekaterina Nesterenko, Evgeny Korobov, Yulia Semernina, Sergey Yakunin	A complex algorithm for selecting instruments to finance mergers and acquisitions
	Anastasia Stepanova, Eugene Korobov, Andrey Vlasov, Sergei Mironov	Clusterization of Geo-Tagged Data for Finding Tourists Attractions

XII корпус СГУ, ауд. 430

14.30–15.45	Секция «Риски экономических систем» (председатель: Балаш О. С.)	
	Жадан И. Э., Мамаева Л. Н.	«Подводные камни» цифровой экономики
	Сенокосова О. В.	Риски цифровизации рынка труда России
	Коротковская Е. В., Смолов Ф. М.	Стратегии инновационного развития компаний как способ преодоления рисков компании
	Солодкая Т. И., Тали М. М., Индустриев М. А.	Математическое моделирование влияния банковского кредита на экономический рост
	Аблязова Р. К., Нестеренко Е. А., Коробов Е. А.	Адаптивная методика управления финансовыми ресурсами компании в условиях высокой долговой нагрузки
	Челнокова О. Ю., Гильманов Д. С.	Моделирование воздействия информационных технологий на развитие национальной экономики
	Tali M. M., Dahash F. J.	The analysis of bank credit and an impact on economic growth
	Филатова И. Н., Дерунов В. А.	Стратегии повышения конкурентоспособности инновационной продукции в АПК
	Трифонов Б. И.	Демографические риски в социально-экономической сфере
	Коротковская Е. В.	Стратегии компаний-лидеров инновационного развития
15.45–16.00	Перерыв	

X корпус СГУ, ауд. 503

16.00–17.00	Секция «Компьютерное моделирование рисков» (председатель: Файзлиев А. Р.)	
	Алексеев А. О.	Согласование политики риск-менеджмента организации при коллегиальном органе управления
	Шапошников К.	Анализ сложных сетевых структур на примере социальной сети Twitter
	Левшунов М. А., Миронов С. В., Файзлиев А. Р., Сидоров С. П.	Восстановление последовательности магистратов в античных греческих полисах: как свести проблему к задаче коммивояжера, используя эвристический подход

	Сидоров С. П., Файзлиев А. Р., Левшунов М. А., Чекмарева А. Ж., Гудков А. А., Коробов Е. А.	Метод кластеризации на основе графов для выявления экономических и финансовых событий с использованием данных новостной аналитики
	Шебалдин В. Р.	О модели Рамсея с ограничением на капитал предприятия
	Новиков В. В., Худошина А. О.	О состоятельности оценок ортогонального разложения
XII корпус СГУ, ауд. 430		
16.00–17.00	Секция «Риски экономических систем» (председатель: Челнокова О. Ю.)	
	Балаш О. С.	Представление пространственных данных при статистическом анализе
	Айриева А. Н.	Совершенствование финансового планирования за счет эффективного управления дебиторской и кредиторской задолженностью
	Коротковская Е. В., Коротковская Е. С.	Инновации как мультипликатор роста конкурентных преимуществ и выручки компаний
	Варламова Т. П., Варламова М. А.	Совершенствование методов оценки рисков потребительского кредитования
	Варыгин С. А.	Использование опционов как инструментов отложенных расчетов при осуществлении сделок в сфере слияний и поглощений
	Худян Р. Г., Карапетян Э. О.	Криптовалютный рынок как перспектива развития современной мировой экономики
	Водяненко М. И.	О подходах к систематизации рисков в агростраховании
	Пономарев Л. А.	Математическое моделирование стоимости криптовалют
	Заалишвили К. Б., Кашапов А. Х., Гарафутдинов Р. В.	Сравнительный анализ и выбор средств Business Intelligence с применением метода анализа иерархий
	Мурашова А. С., Дерунова Е. А.	Методы оценки конкурентоспособности инновационной продукции в АПК

IX корпус СГУ, ауд. 322

16.00–17.00	The Third Workshop on Computer Modelling in Decision Making (moderator: Pleshakov M. G.)	
	Mariia Karelina	Classifying the sectors of the Russian economy by the level of integration activity based on the use of the model for the splitting of probability distributions
	Sergey Arzhenovskiy, Andrey Bakhteev	Model of Audit Risk Assessment
	Vladimir Abramov, Ekaterina Liskina	Calculation of the sales volume flow based on a game model
	Marina Arkhipova, Julia Serbova	Economic Consequences of the Development of Digital Technologies in Russia
	Victor Kolesnikov, Vasily Anikin, Eugene Korobov, Maria Zemlyanskaya, Michael Pleshakov	Food Web Analysis of Khvalynsky National Park Using Different Graph Centrality Measures
17.00–17.15	Перерыв	

IX корпус СГУ, ауд. 402

17.15–19.00	Секция «Математическое моделирование экономических и финансовых рисков» (председатель: Ромакина О. М.)	
	Сарсенова А. З.	Исследование взаимосвязи между интенсивностью новостного потока и объемом биржевых торгов
	Власов А. А., Файзлиев А. Р., Коротковская Е. В., Сидоров С. П., Смолов Ф. М.	Максимизация полезности для инвестора с асимметричным отношением к прибылям и убыткам по эффективной границе
	Задворная И. А., Ромакина О. М.	Применение алгоритмов Data Mining для анализа данных в сфере кредитования
	Гришина Н. П., Хомченко А. А.	Utility Maximization for an Investor with Asymmetric Attitude to Gains and Losses over the Mean-Variance Efficient Frontier
	Гусенкова М. С., Ромакина О. М.	Организация хранения и обработки информации об абитуриентах с помощью технологии NoSQL
	Шаталина А. В., Кашкина М. В.	Нейронные сети в портфельном инвестировании

	Зайнышева Д. А.	Методы аппроксимации в задачах машинного обучения
	Шаталина А. В., Родионова Е. М.	Использование корреляционно-регрессионного метода при анализе предприятий
	Новиков В. В., Лю С. В.	Непараметрическая регрессия интерполяционного типа
IX корпус СГУ, ауд. 402		
13.30–14.30	Стендовая секция	
	Мыльцина А. С.	Базисы типа Хаара и их приложения к обработке информации
	Свечников Е. А.	Информационное обеспечение страхового бизнеса
	Кашкина М. В.	Нейронные сети в портфельном инвестировании
	Дынин Н. В.	Разработка экспертной системы для помощи диагностики неисправности ПК
	Ройзина А. И.	Анализ многомерных данных
	Зайнышева Д. А.	Методы аппроксимации в задачах машинного обучения
	Власов В. А.	Задача распознавания образов и алгоритмы ее решения
	Тряпкина Т. С.	Алгоритмы анализа распределения степеней в сетевых структурах
	Алексеев Д. А.	Разработка жадных алгоритмов для обучения искусственных нейронных сетей
	Лю С. В.	Эконометрическое моделирование экономического роста
	Дранищева А. Л.	Модели временных рядов в анализе рынка акций
	Золотухин М. С.	Модели временных рядов в анализе рынка акций
	Милевский А. А.	Разработка приложения для решения задач классификации
	Шевченко К. В.	Обработка биржевых данных при помощи нейросетей
	Беляев А. И.	Разработка приложения для автоматизации процесса ранжирования

	Зима К. В.	Фреймы и воспроизводящие ядра в теории обучения
	Перекрестова А. А.	Проблемы дискретизации и восстановления с приложениями к анализу данных
	Менухова А. В.	Моделирование процессов диффузии в графах для анализа системных рисков сложных систем
	Бердникова А. С.	Применение фракталов в моделировании временных рядов
	Нагаева Л. В.	Прогнозирование курсов валют
	Чуйков А. А.	Полиномиальная регрессия и ортогональные системы
	Табаков Е. О.	Математическая обработка и анализ результатов психологического тестирования
	Мыльцин В. В.	Дискретное преобразование Виленкина-Крестенсона и его приложения к обработке информации

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://risk2018.sgu.ru/>