



ОБРАЗОВАТЕЛЬНО-НАУЧНЫЙ
ИНСТИТУТ РИСКОВ СГУ



Национальный исследовательский Саратовский
государственный университет имени Н.Г. Чернышевского
Институт рисков СГУ
механико-математический факультет СГУ
экономический факультет СГУ

Международная научно-практическая конференция

**«МАТЕМАТИЧЕСКОЕ МОДЕЛИРОВАНИЕ
В УПРАВЛЕНИИ РИСКАМИ»**

Саратов, 3 — 5 сентября 2012 г.

ПРОГРАММА КОНФЕРЕНЦИИ

Регистрация участников конференции будет проводиться:

3 сентября 2012 г. с 10:00 до 14:00 в IX корпусе СГУ, ауд. 322
(Саратов, ул. Астраханская, 83, угол ул. Большой Казачьей)

Оргкомитет

ОРГАНИЗАЦИОННЫЕ СТРУКТУРЫ КОНФЕРЕНЦИИ

Оргкомитет конференции

Председатель организационного комитета:

Коссович Леонид Юрьевич, д. ф.-м. н., проф., ректор СГУ

Члены организационного комитета:

Балаш Владимир Алексеевич, д.э.н., проф.

Балаш Ольга Сергеевна, к.э.н., доцент

Захарова Татьяна Григорьевна, к.пед.н., доцент

Захаров Андрей Михайлович, к.ф.-м.н., доцент

Сидоров Сергей Петрович, к.ф.-м.н., доцент

Устьянцев Владимир Борисович, д.ф.н., профессор

Программный комитет конференции

Председатель программного комитета:

Мхитарян Владимир Сергеевич, д.э.н., проф., Государственный университет «Высшая школа экономики»

Члены программного комитета:

Балаш Владимир Алексеевич, д.э.н., проф., СГУ

Дудов Сергей Иванович, д.ф.-м.н., проф., СГУ

Богачкова Людмила Юрьевна, д.э.н., проф., Самарский госуниверситет

Балаш Ольга Сергеевна, к.э.н., доцент, СГУ

Париш Дате, Брунельский университет, Лондон

Сидоров Сергей Петрович, к.ф.-м.н., доцент, СГУ

РЕГЛАМЕНТ РАБОТЫ КОНФЕРЕНЦИИ

3.09.2012 (IX корпус СГУ, механико-математический факультет)

10:00—14:00 — Регистрация (IX корпус СГУ, ауд. 322)

14:00—14:10 — Открытие конференции

14:15—16:00 — Заседание секции «Математические модели и методы анализа и исследования рисков»

4.09.2012 (XII корпус СГУ, экономический факультет)

15:30—17:00 — Заседание секции «Методы управления рисками»

4.09.2012 (XII корпус СГУ, философский факультет)

14:00—17:00 — Заседание секции «Философская концепция риска»

5.09.2012 (IX корпус СГУ, механико-математический факультет)

15:30—17:00 — Круглый стол «Проблемы моделирования рисков» и закрытие конференции

Регламент выступлений:

- Секционные доклады — 15 мин.
- Вопросы и обсуждение после доклада — 5 мин.

СЕКЦИИ КОНФЕРЕНЦИИ

Аудитория	Название секции	Председатель
IX корпус СГУ, ауд. 205	Математические модели и методы анализа и исследования рисков	Балаш Владимир Алексеевич
XII корпус СГУ, ауд. 429	Методы управления рисками	Балаш Ольга Сергеевна
XII корпус СГУ, ауд. 203	Философская концепция риска	Устьянцев Владимир Борисович

ПРОГРАММА ЗАСЕДАНИЙ

3 СЕНТЯБРЯ 2012 г.

IX корпус СГУ, ауд. № 205

14:00—14:10

Открытие конференции

Приветственное слово декана механико-математического факультета **А.М. Захарова**

СЕКЦИЯ 1. Математические модели и методы анализа и исследования рисков

14:10—18:00

IX корпус СГУ, ауд. № 205

1. **С. И. Дудов** (Саратов). О построении индикаторов рынка ценных бумаг на основе оценок и приближения сегментных функций
2. **В. А. Балаш** (Саратов). Бутстреп-процедуры оценки величины финансового риска
3. **С. П. Сидоров** (Саратов). GARCH models with jumps
4. **И. Ю. Выгодчикова** (Саратов). О моделировании структуры финансовых операций с равномерно распределённым риском
5. **А. Д. Луньков, А. В. Харламов** (Саратов). Построение вероятностных моделей продолжительности жизни
6. **Н. А. Кучер** (Саратов). Оценка стохастической волатильности с использованием пакета прикладных программ OpenBugs

7. **Д. С. Смирнова** (Саратов). Модели многокритериальной оптимизации с частично упорядоченным множеством критериев
8. **А. В. Спиридонова** (Саратов). Проверка стабильности финансовых результатов российских паевых инвестиционных фондов
9. **А. А. Хомченко, Н. П. Гришина, С. П. Сидоров** (Саратов, Лондон, Саратов). Сравнение методов нахождения оптимального портфеля с учетом теории перспектив
10. **А. И. Малинский, А. С. Ревуцкий** (Саратов). Модель динамики условной волатильности с объемом торгов
11. **А. Р. Файзлиев** (Саратов). Кластеризация объектов городской среды как инструмент снижения экономических рисков

Заочное участие

12. **Н. А. Баранов** (Москва). Моделирование динамики риска функционирования системы в условиях внешних угроз
13. **Е. К. Волосова** (Москва). Об одном вопросе портфельного инвестирования в теории линейного стохастического рынка
14. **В. И. Малюгин, Н. В. Гринь** (Минск, Гродно). Оценка и анализ динамики кредитных рейтингов нефинансовых предприятий на основе статистических методов и моделей
15. **О. Н. Литвинова** (Луганск). Использование конечных динамических систем для моделирования и анализа рисков в экономике
16. **М. Г. Поликарпова** (Магнитогорск). Экономико-математическое моделирование уровня риска оценки синергетического эффекта в сделках слияния и поглощения
17. **О. В. Филатова, П. И. Иванов** (Феодосия). Моделирование динамики риска функционирования системы в условиях внешних угроз
18. **V. Soldatov (Brunel University, London, UK)**. Convergence assessment techniques for Markov Chain Monte Carlo simulations of Stochastic Volatility Model

4 СЕНТЯБРЯ 2012 г.

СЕКЦИЯ 2. Методы управления рисками

14:00—16:00 XII корпус СГУ, ауд. 429

1. **С. В. Ермасов** (Саратов). Модель смешанного финансирования интегрального чистого риска
2. **Г. М. Иванов** (Саратов). Детерминированная оценка риска экономической деятельности фирмы
3. **С. В. Иванилова** (Саратов). Вероятностная модель оценки инновационных рисков
4. **П. В. Гусятников** (Саратов). Расчет ожидаемых потерь при оценке кредитного риска
5. **Е. В. Чистопольская, А. А. Фирсова** (Саратов). Портфельный подход к оценке эффективности инновационных проектов
6. **М. В. Голубниченко** (Саратов). Управление налоговыми рисками на предприятии: практические инструменты
7. **А. Н. Айриева** (Саратов). Особенности управления рисками инвестиций в России
8. **А. И. Землянухин** (Саратов). Базель-III в России: за и против

Заочное участие

9. **О. А. Хохлова** (Улан-Удэ). Проблемы оценивания рисков экономической деятельности
10. **Н. Н. Подольная** (Саранск). Детерминированный факторный анализ влияния занятости в неформальном секторе на развитие экономической деятельности в регионе
11. **Е. В. Горобец** (Феодосия). Статистическая модель демографической безопасности Автономной Республики Крым

12. **И. О. Сухарева** (Москва). Процентный риск в российском банковском секторе: перспективы и ограничения 2012-2013 гг.
13. **Т. Н. Иванова** (Феодосия). Методические подходы к оцениванию эффективности деятельности предприятий малого бизнеса

4 СЕНТЯБРЯ 2012 г.

СЕКЦИЯ 3. Философская концепция риска

14:00—17:00 XII корпус СГУ, ауд. 203

1. **В. Б. Устьянцев** (Саратов). Развертывание философской концепции риска
2. **М. О. Орлов** (Саратов) Человек рискующий в условиях глобализации
3. **В. П. Барышков** (Саратов). Ритмы эпохи и мера риска
4. **Е. В. Листвина** (Саратов). Рискогенное пространство культуры
5. **Н. Г. Волкова** (Саратов). Экстремум и экстремальность в обществе риска
6. **Д. А. Аникин** (Саратов). Топология риска: методологические основания исследования
7. **Ж. О. Посунько** (Саратов). Роль социокультурной среды и коммуникаций в восприятии террористических рисков
8. **Э. Р. Фахрудинова** (Саратов). Духовные традиции Китая в глобальном обществе риска
9. **В. С. Ерохин** (Саратов). Экзистенциальные и социальные риски социализации личности
10. **Д. С. Федин** (Саратов). Воздействие экономических рисков на формирование личностного бытия
11. **Д. М. Соколова** (Саратов). Трансформация социального: риски и стратегии их минимизации
12. **Н. А. Стеклова** (Саратов). Локальные и глобальные коммуникационные конфликты в пространстве рискогенных территорий
13. **Д. И. Заров** (Саратов). Цивилизационные риски в процессах социального развития

14. **И. А. Абросимова** (Саратов). Антиномии идеологии в обществе риска
15. **О. Ф. Филимонова** (Саратов). Образ риска как предпосылка социального действия
16. **Г. В. Епифанова** (Саратов). Глобальная культура: риск возможности и риск действительности
17. **Е. Д. Зарова** (Саратов). Встреча с «Другим» как риск цивилизационного развития
18. **В. Ю. Кравцова** (Саратов). Трансформация ценностного пространства как фактор риска
19. **С. М. Фролова** (Саратов). Рискогенность в рамках повседневности

5 СЕНТЯБРЯ 2012 г.

КРУГЛЫЙ СТОЛ «Проблемы моделирования рисков»

15:30—17:00 IX корпус СГУ, ауд. № 322

Закрытие конференции.