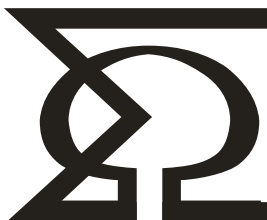


Национальный Исследовательский Университет «Высшая Школа Экономики»
Центральный экономико-математический институт РАН
Московская школа экономики МГУ им. М.В. Ломоносова
Журнал «Прикладная эконометрика»

ХII-я Международная конференция

**«Применение многомерных статистических методов
в экономике и оценке качества им. С.А. Айвазяна»**



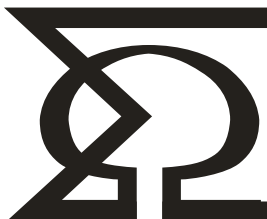
Москва, 21–23 сентября 2022 г.

Пригласительный билет и программа конференции

Москва
НИУ ВШЭ
2022

National Research University «Higher School of Economics»
RAS Central Economics and Mathematics Institute
Moscow School of Economics of Moscow State University (MSE MSU)
Journal «Applied Econometrics»

**XII International Conference on
Multivariate Statistics and Quality Control
in Honour of Prof. Seigei Aivazyan**



Moscow, 21-23 September 2022

Invitation and Conference Program

Moscow 2022

Уважаемый коллега!

Программный и Оргкомитет конференции приглашают Вас принять участие в конференции «Применение многомерного статистического анализа в экономике и оценке качества им. С.А.Айвазяна».

Ваш доклад включен в программу конференции.

**Конференция будет проходить 21–23 сентября 2022г.
в г.Москве в помещении НИУ ВШЭ**

День заезда – 20 сентября

Открытие и первое пленарное заседание – 21 сентября

День отъезда – 24 сентября

Сайт конференции: <https://economics.hse.ru/dest/statanalysis/2022/>

Адрес Оргкомитета: НИУ ВШЭ,
г. Москва, Покровский бульвар, дом 11, каб.S429.

Регистрация участников 21 сентября 2022г. с 9³⁰ в фойе ауд. Т-510.

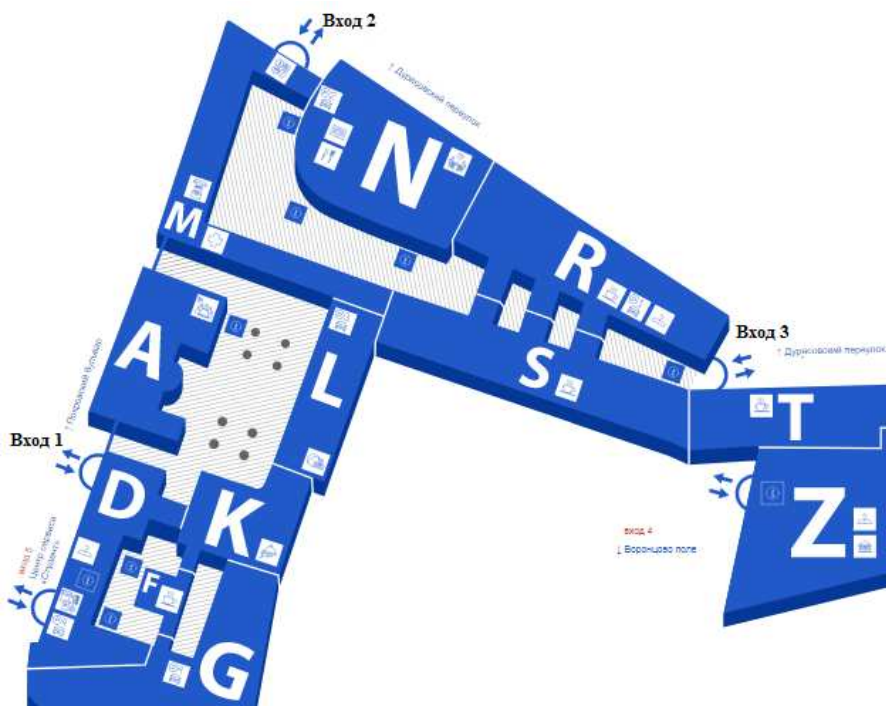
Пленарные заседания будут проходить в ауд. **Т-510**

Заседания секций в ауд. – **Т-510, R-504**

Расходы, связанные с проездом и проживанием иногородних участников конференции, оплачиваются за счет командирующей стороны.

Карта комплекса НИУ ВШЭ <https://www.hse.ru/buildinghse/pokrovka/>

Обратите внимание, что пройти в здание ВШЭ на конференцию можно через входы 1,2,3: с Покровского бульвара (вход 1) и Дурасовского переулка (вход 2,3). При себе необходимо иметь паспорт.



Справки по телефону и E-mail:

+7-495-772-95-90 *26136

vmkhitarian@hse.ru (Мхитарян Владимир Сергеевич – НИУ ВШЭ)

vsirotin@hse.ru (Сиротин Вячеслав Павлович – НИУ ВШЭ)

lrodionova@hse.ru (Родионова Лилия Анатольевна – НИУ ВШЭ)

Программный комитет конференции:

Макаров Валерий Леонидович	председатель
Мхитарян Владимир Сергеевич	зам. председателя
Афанасьев Михаил Юрьевич	зам. председателя
Родионова Лилия Анатольевна	уч. секретарь
Конаков Валентин Дмитриевич	член программного комитета
Елисеева Ирина Ильинична	член программного комитета

Организационный комитет конференции:

Мхитарян Владимир Сергеевич	председатель
Сиротин Вячеслав Павлович	зам. председателя
Макарчук Нина Ивановна	уч. секретарь
Архипова Марина Юрьевна	член оргкомитета
Грачева Светлана Сергеевна	член оргкомитета
Звездина Наталья Валерьевна	член оргкомитета

Регламент работы конференции предусматривает проведение пленарных заседаний с 10⁰⁰ до 14⁰⁰ и заседаний секций с 14³⁰ до 18⁰⁰ — 21 и 22 сентября.

- Секция 1: **Теория и методология**
- Секция 2: **Использование многомерного статистического анализа (МСА) и эконометрики в анализе качества жизни населения**
- Секция 3: **Анализ финансовых рынков, банков, страхования и валютных курсов**
- Секция 4: **Социально-экономическое развитие регионов России**
- Секция 5: **Макроэконометрической анализ**
- Секция 6: **Приложения многомерного статистического анализа (МСА)**

Расписание работы XII-ой Международной конференции
*«Применение многомерного статистического анализа
в экономике и оценке качества им. С.А.Айвазяна»*

Адрес: Москва, Покровский бульвар, д. 11, НИУ ВШЭ, ауд. Т-510.

Среда, 21 сентября 2022 г.				Четверг, 22 сентября 2022 г.			
10 ⁰⁰ – 14 ⁰⁰ Ауд. Т-510 Webinar 1	Открытие конференции Пленарное заседание 1 Рук. Мхитарян В.С., Елисева И.И.			10 ⁰⁰ – 14 ⁰⁰ Ауд. Т-510 Webinar 2	Пленарное заседание 2 Рук. Афанасьев М.Ю.,		
14 ⁰⁰ – 14 ³⁰	Кофе-брейк (ауд. S-419)			14 ⁰⁰ – 14 ³⁰	Кофе-брейк (ауд. S-419)		
14 ³⁰ – 16 ⁰⁰	Заседания секций			14 ³⁰ – 16 ⁰⁰	Заседания секций		
	секц.	руководитель	Ауд./ Webinar		секц.	руководитель	Ауд./ Webinar
	1	Коваленко А.П.	R-504		5	Мхитарян С.В.	T-510
	2	Суринов А.Е.	T-510	4	Антоханова И.В.	R-504	
16 ⁰⁰ – 16 ³⁰	Кофе-брейк (ауд. S-419)			16 ⁰⁰ – 16 ³⁰	Кофе-брейк (ауд. S-419)		
16 ³⁰ – 18 ⁰⁰	Заседания секций			16 ³⁰ – 18 ⁰⁰	Заседания секций		
	секц.	руководитель	Ауд./ Webinar		секц.	руководитель	Ауд./ Webinar
	3	Балаш В.А.	T-510		4	Вакуленко Е.С.	T-510
	6	Архипова М.Ю.	R-504	6	Бакуменко Л.П.	R-504	

Webinar 1-2: идентификаторы конференции будут доступны на сайте конференции

Регламент выступлений: пленарное заседание – 30 мин.,
заседание секций – 10-15 мин.

Участникам конференции рекомендуется подготовить презентацию (PowerPoint или PDF) для своего доклада.

ПЕРВЫЙ ДЕНЬ КОНФЕРЕНЦИИ, 21 сентября 2022 г.

9⁴⁵ – 10⁰⁰ **Открытие конференции**

ПЛЕНАРНОЕ ЗАСЕДАНИЕ 1

10.00 – 13.30

Аудитория Т-510

Webinar 1

Председатель — **Мхитарян Владимир Сергеевич**

- Елисеева Ирина Ильинична, Декина Мария Павловна*
(Санкт-Петербург, СПбГЭУ)
10⁰⁰ – 10³⁰: Многоуровневое моделирование в анализе доходов и заработной платы
- Афанасьев Михаил Юрьевич (Москва, ЦЭМИ РАН)*
10³⁰ – 11⁰⁰: Новые ориентиры в диверсификации региональной экономики
- Балаш Владимир Алексеевич, Сидоров Сергей Петрович*
(Саратов, СГУ им. Н.Г.Чернышевского)
11⁰⁰ – 11³⁰: Моделирование влияния внешней конъюнктуры на переливы волатильности между российскими активами
- Демидова Ольга Анатольевна (Москва, НИУ ВШЭ)*
11³⁰ – 12⁰⁰: Пространственные аспекты отношения к иммигрантам в России

Председатель — **Елисеева Ирина Ильинична**

- Харин Юрий Семенович (Минск, БГУ)*
12⁰⁰ – 12³⁰: Нейросетевые модели биномиальных временных рядов и их статистический анализ
- Шведов Алексей Сергеевич, Связов Владимир Андреевич*
(Москва, НИУ ВШЭ)
12³⁰ – 13⁰⁰: Применение нечеткой логики при анализе данных и прогнозировании
- Fantazzini Dean (Moscow, MSEMSU)*
13⁰⁰ – 13³⁰: Crypto-exchanges and Credit Risk: Modelling and Forecasting the Probability of Closure
- Morozova Ekaterina, Panov Vladimir (Moscow, HSE)*
13³⁰ – 14⁰⁰: Mellin Transform Techniques for the Statistical Inference
- 14⁰⁰ – 14³⁰: **кофе-брейк**

ПЕРВЫЙ ДЕНЬ КОНФЕРЕНЦИИ, 21 сентября 2022 г.

14³⁰ – 16⁰⁰

Аудитория R-504

Секция №1: Теория и методология

Webinar 2

Председатель — **Коваленко Андрей Петрович**

1. *Kelbert Mark, Kasyanova X. (Moscow, HSE)*

Conicting experts' opinions in Bayesian problems

2. *Агапова Татьяна Николаевна, Агапов Сергей Михайлович*

(Москва, МосУ МВД России им. В.Я.Кикотя)

Случайное многообразие элементов природных и социально-экономических систем

3. *Герасимова Ирина Александровна, Герасимова Елена Владимировна*

(Москва, ЦЭМИ РАН)

Пространственная дезинтеграция траекторий социально-экономического развития регионов

4. *Конаков Валентин Дмитриевич, Биттер Илья Игоревич*

(Москва, НИУ ВШЭ)

Устойчивость переходных плотностей диффузий и цепей Маркова относительно возмущений коэффициентов

5. *Макарчук Нина Ивановна (Москва, ЦЭМИ РАН)*

Вспоминая работу с С.А.Айвазяном

14³⁰ – 16⁰⁰

Секция №2: Использование многомерного статистического анализа (МСА) и эконометрики в анализе качества жизни населения

Аудитория T-510

Webinar 2

Председатель — **Суринов Александр Евгеньевич**

1. *Архипова Марина Юрьевна, Сиротин Вячеслав Павлович*

(Москва, НИУ ВШЭ)

Подходы к исследованию трансформации образа жизни людей в цифровой среде современного мегаполиса

2. *Луппов Артур Борисович, Суринов Александр Евгеньевич*

(Москва, НИУ ВШЭ)

Статистическая оценка материального благосостояния локальных социумов в России. Проблемы и направления исследований

3. *Сажин Юрий Владимирович, Скворцова Марина Александровна*
(Саранск, МГУ им. Н.П.Огарева)

Теория и методология исследования социальной комфортности проживания населения региона

4. *Трофимова Наталия Аристарховна* (Москва, ЦЭМИ РАН)

Применение пространственных моделей при оценке влияния регионального социального капитала

5. *Мхитарян Сергей Владимирович* (Москва, РЭУ им. Г.В.Плеханова)

Интегрированная оценка транспортной доступности жилищных комплексов Москвы

6. *Мироненков Алексей* (Москва, МШЭ МГУ им. М.В.Ломоносова)

Интервальные оценки показателей интегрального индикатора качества жизни населения в зависимости от выбора весов взвешенной главной компоненты

16⁰⁰ – 16³⁰: **кофе-брейк**

16³⁰ – 18⁰⁰ **Секция №3: Анализ финансовых рынков,
банков, страхования и валютных курсов**

Аудитория Т-510

Webinar 2

Председатель — **Балаш Владимир Алексеевич**

1. *Балаш Ольга Сергеевна, Файзлиев Алексей Раисович*
(Саратов, СГУ им. Н.Г.Чернышевского)

Применение марковских моделей со множеством состояний для прогнозирования кредитных рейтингов

2. *Беляков Антон Олегович, Курбацкий Алексей Николаевич, Мироненков Алексей Алексеевич* (Москва, МШЭ МГУ им. М.В.Ломоносова)

Прогнозирование финансовых доходностей и интервалов цен при помощи представления в пространстве состояний

3. *Зверева Валерия Андреевна* (Москва, НИУ ВШЭ)

Влияние уровня неравенства на работу трансмиссионного механизма денежно-кредитной политики Центрального банка РФ

4. *Коваленко Андрей Петрович* (Москва, НИУ ВШЭ)

Геометрическая интерпретация многослойного перцептрона с кусочно-линейными функциями активации

5. *Сурков Антон Александрович (Москва, ИЭ РАН)*

Решение проблемы отрицательности весовых коэффициентов объединенного прогноза

16³⁰ – 18⁰⁰

**Секция №6: Приложения многомерного
статистического анализа (МСА)**

Аудитория R-504

Webinar 2

Председатель — Архипова Марина Юрьевна

1. *Арутюнов Арсен Левонович (Москва, ЦЭМИ РАН)*

Применение многомерно-статистических методов для измерения сложности выполнения нотариальных операций правового – технического характера в РФ

2. *Радионова Марина Владимировна (Пермь, ПГНИУ)*

Кластеризация регионов РФ по уровню ИКТ

3. *Козлова Мария Александровна (Екатеринбург, УрФУ)*

Эконометрическая оценка отклонения ИПЦ по данным Выборочного обследования бюджетов домашних хозяйств

4. *Микитчук Марина Дмитриевна (Москва, ЦЭМИ РАН)*

Социально-экономические детерминанты альтруизма в развитых и развивающихся странах

6. *Шишов Владимир Федорович, Искоркин Дмитрий Викторович
(Пенза, ВА МТО)*

Применение статистических функций MSExcel для анализа и прогнозирования

ПЛЕНАРНОЕ ЗАСЕДАНИЕ 2

10.00 – 13.30

Аудитория Т-510

Webinar 1

Председатель — Афанасьев Михаил Юрьевич

- 10⁰⁰ – 10³⁰: *Ниворожкина Людмила Ивановна (Ростов-на-Дону, РГЭУ(РИНХ))*
Декомпозиция доходного неравенства на микроуровне
Зарова Елена Викторовна (Москва, РЭУ им. Г.В.Плеханова),
Турсунов Бобир Ортикмирзаевич (Ташкент, ТГЭУ),
- 10³⁰ – 11⁰⁰: *Коваленко Н.Н. (Москва, РЭУ им. Г.В.Плеханова)*
Модели промышленных бизнес-циклов стран Средней Азии в анализе межстранового влияния угроз экономической безопасности
Мхитарян Владимир Сергеевич (Москва, НИУ ВШЭ),
Шишов Владимир Федорович, Искоркин Дмитрий Викторович (Пенза, ВА МТО)
- 11⁰⁰ – 11³⁰:
Модель прогрессивной шкалы налогообложения и возможности её применения в России
- 11³⁰ – 12⁰⁰: *Дуброва Татьяна Абрамовна (Москва, НИУ ВШЭ),*
Есенин Михаил Алексеевич (Москва, МИРЭА)
Анализ цифровой активности в различных размерных группах предприятий
- Проневич Андрей Францевич (Минск, ГрГУ им. Янки Купалы),*
Хацкевич Геннадий Алексеевич (Минск, ИБ БГУ)
- 12⁰⁰ – 12³⁰:
Динамические трехфакторные производственные функции, учитывающие нейтральный по Хиксу научно-технический прогресс
Лугачев Михаил Иванович, Скрипкин Кирилл Георгиевич (Москва, МГУ им. М.В.Ломоносова)
- 12³⁰ – 13⁰⁰:
Импортозамещение на уровне фирмы: взгляд с позиций совокупной стоимости владения
Картаев Филипп Сергеевич, Гуров Илья Николаевич (Москва, МГУ им. М.В.Ломоносова),
- 13⁰⁰ – 13³⁰:
Выбор режима монетарной политики и неопределенность инфляционных ожиданий
Вакуленко Елена Сергеевна, Митрофанова Екатерина Сергеевна (Москва, НИУ ВШЭ),
- 13³⁰ – 14⁰⁰:
Применение APC моделей для исследования процессов рождаемости в России
- 14⁰⁰ – 14³⁰: **кофе-брейк**

ВТОРОЙ ДЕНЬ КОНФЕРЕНЦИИ, 22 сентября 2022 г.

14³⁰ – 16⁰⁰

Аудитория Т-510

Секция №5: Макроэконометрической анализ
Webinar 1

Председатель — **Мхитарян Сергей Владимирович**

Классификация стран по уровню сетевой готовности

1. *Антонян Анна Артуровна (Москва, НИУ ВШЭ)*

Статистический анализ влияния факторов на макроэкономические показатели РФ

2. *Березняцкий Александр Николаевич (Москва, ЦЭМИ РАН)*

Моделирование макроэкономической динамики дотационного региона в России

3. *Лукашин Юрий Павлович (Москва, ИМЭМО РАН)*

Экспорт в экономике Китая

4. *Михненко Олег Евгеньевич (Москва, РУТ (МИИТ))*

Прикладная статистика и управление

5. *Сарычева Татьяна Владимировна (Йошкар-Ола, МарГУ)*

Эконометрический анализ импорта и экспорта угля по панельным данным

16⁰⁰ – 16³⁰:

кофе-брейк

16³⁰ – 18⁰⁰

Секция №4: Социально-экономическое развитие регионов России
Аудитория Т-510

Webinar 1

Председатель — **Вакуленко Елена Сергеевна**

1. *Абдулгалимов Абдулгалим Минхаджевич (Махачкала, ДагГТУ)*

Прогнозирование бракоразводных процессов в Республике Дагестан

2. *Горский Дмитрий Ильич (Москва, НИУ ВШЭ)*

Рождаемость в России в периоды рецессий

3. *Митрофанова Екатерина Сергеевна, Вакуленко Елена Сергеевна, Горский Дмитрий Ильич (Москва, НИУ ВШЭ)*

Влияние первой волны COVID-19 на репродуктивные намерения россиян
(март-май 2020 г.)

4. *Михайлова Светлана Сергеевна, Антоханова Инна Владимировна. (Улан-Удэ, ВСГУТУ)*

Концептуальные основы проектирования интеллектуальной информационной системы демографических показателей

5. *Родионова Лилия Анатольевна (Москва, НИУ ВШЭ)*

Региональные особенности сезонности рождений в РФ: эконометрический подход

ВТОРОЙ ДЕНЬ КОНФЕРЕНЦИИ, 22 сентября 2022 г.

14³⁰ – 16⁰⁰ Секция №4: Социально-экономическое развитие регионов России
Аудитория R-504 Webinar 2

Председатель — Антоханова Инна Владимировна

1. *Березняцкий Александр Николаевич,
Бадина Светлана Вадимовна,
Бабкин Роман Александрович (Москва, ЦЭМИ РАН)*
Классификация районов Москвы в контексте уязвимости к природным и техногенным опасностям на основе данных сотовых операторов
2. *Галева Екатерина Андреевна (Москва, РАНХиГС)*
Анализ региональной специфики конкуренции на розничном рынке нефтепродуктов в РФ
3. *Мхитарян Владимир Сергеевич (Москва, НИУ ВШЭ),
Попова Галина Львовна (Москва, РЭУ им. Г.В. Плеханова)*
Анализ развития сельского хозяйства в регионах Центрально-Черноземного экономического района
4. *Нанавян Аишен Мардиросовна (Москва, ЦЭМИ РАН)*
Экономическая неактивность: динамика и региональные особенности
5. *Наринян Наталья Евгеньевна (Москва, ЦЭМИ РАН)*
ВРП и удовлетворенность трудом в регионе
6. *Замниус Алексей Васильевич,
Полбин Андрей Владимирович (Москва, РАНХиГС)*
Оценка эластичности предложения труда по заработной плате для замужних женщин в России

16⁰⁰ – 16³⁰: **кофе-брейк**

16³⁰ – 18⁰⁰

Секция №6: Приложения многомерного
статистического анализа (МСА)

Аудитория R-504

Webinar 2

Председатель — **Бакуменко Людмила Петровна**

1. *Никитина Наталья Сергеевна (Москва, РАНХиГС)*

Анализ факторов, влияющих на динамику цен на жилую недвижимость в России

2. *Семерикова Елена Вячеславовна, Блохина Анастасия Олеговна (Москва, НИУ ВШЭ)*

Spatial Quantile Analysis of Real Estate Prices in Germany

3. *Шаклеина Марина Владиславовна, Шаклеин Константин Игоревич (Москва, МШЭ МГУ им. М.В.Ломоносова)*

Оценка пространственного взаимодействия факторов предпринимательской активности

4. *Хохлова Оксана Анатольевна, Хохлова Александра Николаевна (Улан-Удэ, ВСГУТУ)*

Технологические тренды: анализ и прогнозирование

5. *Карелина Мария Геннадьевна (Магнитогорск, МГТУ им. Г.И.Носова)*

Эконометрическая модель интеграционной активности в России с учетом факторов ESG

10⁰⁰ – 12³⁰

Аудитория S-419

Подведение итогов конференции

Председатель — Мхитарян Владимир Сергеевич,

Сопредседатель— Сиротин Вячеслав Павлович

ОТЪЕЗД УЧАСТНИКОВ



ФАКУЛЬТЕТ ЭКОНОМИЧЕСКИХ НАУК

Бакалаврская программа «Экономика и статистика»

Академический руководитель программы –

к.т.н., профессор департамента статистики и анализа данных
Сиротин Вячеслав Павлович

Направление подготовки: 38.03.01 “Экономика”

Где читается: Факультет экономических наук
Первый набор на программу - 2008 год

Сайт программы - <https://www.hse.ru/ba/stat/>

Цель программы — подготовка на уровне требований ведущих университетов мира экономистов-статистиков с аналитическим креативным мышлением для статистической поддержки принятия оптимальных управленческих решений в экономике, бизнесе и социальной сфере.

В рейтингах наиболее престижных профессий издания JobsRatedAlmanac, а также кадрового портала CareerCast.com профессия статистика неизменно входит в топ-10 (из 200-250 профессий). Главное содержание деятельности экономиста-статистика – количественная оценка и прогнозирование экономических и социальных явлений.

Профессионализм будущих бакалавров обеспечивается фундаментальной подготовкой по экономической теории и математике, международной методологии социально-

экономических измерений, теории и практике статистического анализа, эконометрического моделирования и прогнозирования.

Студенты образовательной программы «Экономика и статистика» получат также прочные знания в области информационных технологий и современного статистического инструментария, научатся применять полученные знания на практике. Научно-исследовательская работа студентов связана с моделированием реальных социально-экономических явлений и процессов с использованием современных программных средств и компьютерных технологий

Это позволит им стать широко востребованными аналитиками в области экономики, финансов и страхования, способными быть и умелыми управленцами.

Желающие заниматься наукой смогут развиваться в направлении фундаментальных математико-статистических исследований, в области теоретической и прикладной экономики и в широком поле других направлений.

Компетенции, приобретенные в процессе обучения, позволят выпускникам образовательной программы работать:

- в статистических и аналитических подразделениях органов федерального, регионального и муниципального управления;
- в финансовых и аналитических подразделениях, департаментах развития банков, страховых, инвестиционных, рекламных и маркетинговых компаний;
- в научных учреждениях, занятых подготовкой и анализом статистической информации, и учебных заведениях.



ФАКУЛЬТЕТ ЭКОНОМИЧЕСКИХ НАУК

Магистерская программа *«Статистический анализ в экономике»*

Академический руководитель программы –

д.э.н., профессор, руководитель департамента статистики и анализа данных

Суринов Александр Евгеньевич

Направление подготовки: 38.04.01 “Экономика”

Где читается: Факультет экономических наук

Первый набор на программу - 2020 год

Сайт программы - <https://www.hse.ru/ma/statanalysis/>

Цель программы - подготовка высококвалифицированных аналитиков, обладающих глубокими знаниями в области экономической теории, статистических методов измерения и моделирования экономических процессов, международных статистических стандартов.

Отличительной особенностью программы является обучение не только формальным методам анализа, но и международным методологическим стандартам, на основе которых формируются системы статистических показателей в подавляющем большинстве стран мира. Современный уровень знаний обеспечивается активным участием студентов в работе научных семинаров и конференций, организуемых департаментом с привлечением ведущих отечественных и зарубежных специалистов.

Программа построена таким образом, чтобы подготовить специалистов в области информационно-аналитической поддержки принятия управленческих решений и организации экономического мониторинга. Программа нацелена на получение знаний, позволяющих на профессиональном уровне обрабатывать и анализировать массивы экономической информации (включая «большие данные»), выявлять закономерности, прогнозировать и моделировать социально-экономические явления и процессы с применением многомерных статистических методов и последних достижений статистического компьютеринга, интерпретировать результаты исследований и использовать их по направлениям, находящимся в мейнстриме современной экономической науки.

Наряду с дисциплинами, образующими ядро классического экономического образования, в программу вошли курсы дисциплин, нацеленных на получение знаний статистической методологии сбора, обработки, анализа данных и экономико-статистического моделирования. Обязательными курсами являются: микроэкономика, макроэкономика и эконометрика. Программы дисциплин специализации знакомят слушателей с источниками статистической информации, принципами и алгоритмами измерений социально-экономических явлений. В процессе преподавания используются методические приемы, совместно разработанные со Статистическим Институтом для Стран Азии и Тихого Океана ООН в Токио (SIAP).

Выпускники программы найдут себя в аналитических и финансово-экономических подразделениях предприятий и организаций различных форм собственности, системе государственного и муниципального управления, международных организациях, научных учреждениях и учебных заведениях.



ВЫСШАЯ ШКОЛА ЭКОНОМИКИ
НАЦИОНАЛЬНЫЙ ИССЛЕДОВАТЕЛЬСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ

ФАКУЛЬТЕТ ЭКОНОМИЧЕСКИХ НАУК

Магистерская программа

«Стохастическое моделирование в экономике и финансах»

Академический руководитель программы –
PhD, доцент Панов Владимир Александрович

Направление подготовки: 38.04.01 “Экономика”

Где читается: Факультет экономических наук

Сайт программы - <https://www.hse.ru/ma/actuar/>

Старое название программы – Статистическое моделирование и актуарные расчёты (2016-2022 гг).

Концепция программы. Программа была разработана для выпускников бакалавриатов математических, технических и экономических ВУЗов, которые связывают свою дальнейшую профессиональную деятельность со страховыми компаниями, финансовыми институтами, банками и хотят улучшить свои знания в области экономики и применения математических (чаще всего – вероятностных и статистических) методов в финансово-экономических задачах. Экономические курсы, преподаваемые в данной магистерской программе, обеспечивают достаточную базу для понимания предметной области и являются мотивацией для углубленного изучения соответствующих математических дисциплин. Данная программа тесно связана с Международной лабораторией стохастического анализа и его приложений (<https://lsa.hse.ru/>). Ключевые курсы будут прочитаны специалистами лаборатории, имеющими многолетний опыт преподавания в университетах Франции, Германии, Великобритании, США.

Трудоустройство выпускников. Выпускники являются востребованными специалистами во всех сферах деятельности, в

которых находят применение вероятностно-статистические методы.

Основные места трудоустройства выпускников:

- банки и инвестиционные компании;
- аналитические и финансовые службы, департаменты развития предприятий и фирм;
- страховые и аудиторские компании;
- компании, занимающиеся разработкой статистического программного обеспечения;
- наука и образование.

Тесная связь магистерской программы и международной лаборатории стохастического анализа (<http://lsa.hse.ru/>) будет использована для содействия в трудоустройстве выпускников в академической сфере.

В основе данной программы лежат курсы, ориентированные на изучение методов стохастического (вероятностно-статистического) анализа и применение этих методов для моделирования экономических процессов. К данной линейке курсов относятся такие дисциплины, как «Случайные процессы и моделирование», «Введение в стохастические дифференциальные уравнения и числовую вероятность», «Введение в финансовую математику», «Элементы стохастического анализа», «Математико-статистические методы исследования экстремальных событий».

Кроме того, в рамках данной магистерской программы студенты имеют возможность изучить

- базовые экономические дисциплины (Микроэкономика, Макроэкономика, Эконометрика),
- методы анализа данных (Программирование на Python, Современные методы принятия решений и анализа данных, Data mining),
- основы теории страхования и банковского дела (Актуарные расчёты, Математическое моделирование банковской деятельности).