



Программа

Международного семинара «Системные риски в финансовом секторе»

| 16 ноября (пятница) Мясницкая, 11, ауд. 518, НИУ ВШЭ | |
|--|--|
| Время | Сессии |
| 10:00 – 10:30 | Регистрация |
| 10:30 – 10:45 | Открытие семинара, приветственное слово А.М. Карминский, д.э.н., ординарный профессор, Председатель Оргкомитета |
| 10:45-12:45 | Сессия 1 «Keynote talks» <ul style="list-style-type: none">Prof. Massimiliano Caporin «Networks in Risk Spillovers: a Multivariate GARCH Perspective», University of PadovaProf. Emillio Mistrulli «Interbank Lending Patterns and Financial Contagion», Head of Division, Economics & Research, Bank of Italy Обсуждение |
| 12:45-13:00 | Кофе-брейк |
| 13:00-15:00 Модератор: Карминский Александр Маркович | Сессия 2 «Теоретические основы анализа системных рисков» <ul style="list-style-type: none">Столбов Михаил Иосифович «Macrofinancial linkages in the EU countries: evidence from quantile local projections», зав.кафедрой МГИМО, д.э.н. совместно со Щепелевой М.А., к.э.н., НИУ ВШЭЛеонидов Андрей Владимирович «Interbank network topology in the agent-based model of banking system», профессор, д.ф.-м.н., МФТИ совместно с к. ф.-м.н. В. Нечитайло (Физический институт им. П.Лебедева) и Е. Серебрянниковой (МФТИ)Пономаренко Алексей, «When are credit gap estimates reliable?», PhD, Банк России Обсуждение |
| 15:00-16:00 | Обед |
| 16:00-17:00 Модератор: Столбов Михаил Иосифович | Сессия 3 «Меры системного риска» <ul style="list-style-type: none">Солнцев Олег Геннадьевич «Development of scenarios for stress testing based on the system of leading indicators of the crises», зам. генерального директора, к.э.н, совместно с Ренатом Ахметовым и Верой Панковой (все – ЦМАКП)Дьячкова Наталья Федоровна «The credit cycles and its impact on credit ratings changes», НИУ ВШЭ совместно с проф. Карминским А.М., НИУ ВШЭБаранова Василиса, «ACRA’s financial stress indices for Russia, Kazakhstan and China», Analyst at the Research and Forecasting Group, совместно с Д. Куликовым, АСРА Обсуждение |
| 17:00-18:30 Модератор: Лобанов Алексей Анатольевич, Банк России | Сессия 4 «Регулирование системного риска» <ul style="list-style-type: none">Малыхина Светлана Игоревна «Systemic risk measures in banking sector of the Republic of Belarus», к.э.н., BPS-Sberbank, Independent Director, Республика БеларусьСерякова Екатерина Вадимовна «Cross-border transmission of systemic risks of banking sectors of G7 and BRICS countries», Газпромбанк, МГИМОХасянова Светлана Юрьевна, «The Impact of Mortgage Securitization on Bank Performance: Estimation of the Average Treatment Effect», к.э.н., PhD, зав. Кафедрой, НИУ ВШЭ-НН Обсуждение |
| 18:30 | Закрытие семинара Ирина Васильевна Ивашковская, д.э.н., ординарный профессор, НИУ ВШЭ, Школа финансов |
| 17 ноября (суббота) Шаболовка, 26, ауд. 3211, НИУ ВШЭ | |
| 10:30-14:00 Шаболовка, 26, ауд. 3211 | Круглый стол по вопросам развития исследований системных рисков России и за рубежом. Предложения по развитию публикационной активности |