|  |  |
| --- | --- |
| 09 апреля, четверг | |
| 10:00-11:30 Аудитория 513 М-20 | **Сеccия E-05. Финансовые рынки** **Председатель сессии: М. И. Никитин (НИУ ВШЭ)**  А. Н. Задорожная (ОмГУПС), F. Bazzana (University of Trento), R. Gabriele (University of Trento) The role of covenants in bond issue and investment policy. The case of Russian companies ([Аннотация](http://regconf.hse.ru/uploads/1225d218fc8cf3323dc5aaae9085ee2f069e24e5.docx),[полная версия](http://regconf.hse.ru/uploads/4829ae7875462fcfeecd7cd6302ce17cab35c371.pdf))  H. Tan (University of Essex) Joint modeling of ultra-high frequency (UHF) financial data under autoregressive conditional duration (ACD) model specification ([Аннотация](http://regconf.hse.ru/uploads/04f775ecdb0d13d165f1b3a4314e76f99bd0cda3.docx), [полная версия](http://regconf.hse.ru/uploads/8fd987803805bd6d692c11d00c8a691630d03a42.pdf))  К. А. Туманянц (ВолГУ) Стресс-тестирование механизма гарантирования пенсионных накоплений в России ([Аннотация](http://regconf.hse.ru/uploads/d98f742e52832794bf97cef2487fee417d80df38.doc), [полная версия](http://regconf.hse.ru/uploads/4e2b7e7ecc1ddb9f158c6d93af816fab45b9d2fd.pdf))  Дискуссант: А. Е. Абрамов (НИУ ВШЭ) |
| 12:00-13:30 Аудитория 513 М-20 | **Сеccия E-06. Эмпирические исследования финансовых рынков** **Председатель сессии: Т. В. Теплова (НИУ ВШЭ)**  L. Weill (University of Strasbourg) Does the Type of Debt Matter? Stock Market Perception in Europe ([Аннотация](http://regconf.hse.ru/uploads/e96119f8f4961db90303390be743cfe431d4c2af.doc))  А. Е. Абрамов (НИУ ВШЭ), М. И. Чернова (РАНХиГС) Analysis of the effectiveness of pension and mutual fund portfolios in Russia ([Аннотация](http://regconf.hse.ru/uploads/1929908f8a484016020cd410fcac12fbb80e245d.pdf), [полная версия](http://regconf.hse.ru/uploads/009c9978227b1b982944c6533025771e1dd931c7.pdf))  Д. Ю. Руденко (ТюмГУ), Т. В. Погодаева (ТюмГУ) Уровень развития финансового рынка и неравенство по доходам в России ([Аннотация](http://regconf.hse.ru/uploads/97d8e18776ef9ff7a4b852a7ce86fe17cd3cebd2.doc), [полная версия](http://regconf.hse.ru/uploads/a84d38adb64d04782b17f09740265e569ed461bb.doc))  Т. В. Теплова (НИУ ВШЭ), Е. С. Микова (НИУ ВШЭ) Природа моментум эффекта: метод декомпозиции моментум прибыли. ([Аннотация](http://regconf.hse.ru/uploads/51e8852645c70a100af2bf7bf83a7f0eeadf590b.doc), [полная версия](http://regconf.hse.ru/uploads/8a4e9ef0169ec6856e7951fc1b5c4a005cdd98d0.doc))  Дискуссант: Я. Т. Куга (НИУ ВШЭ – Санкт-Петербург) |
| 15:00-16:30 Аудитория 513 М-20 | **Сеccия E-07. Финансовая математика (совместно с Международной лабораторией количественных финансов)** **Председатель сессии: П. К. Катышев (НИУ ВШЭ)**  А. Д. Смирнов (НИУ ВШЭ) Stochastic Leverage of the Global Financial System ([Аннотация](http://regconf.hse.ru/uploads/35a1a72f8e66359e78811cef354c456dbe739a4f.docx))  А. Е. Лепский (НИУ ВШЭ), Г. И. Пеникас (НИУ ВШЭ), А. Г. Броневич (НИУ ВШЭ) Анализ прогностической финансовой информации статистическими метода-ми и в рамках теории свидетельств ([Аннотация](http://regconf.hse.ru/uploads/ccec9c3ad7fc90fc293e15d9fdd4bb58bba9835d.pdf), [полная версия](http://regconf.hse.ru/uploads/41d4739f244da8c682677e58d7c6a88e97aa5d51.pdf))  Я. Т. Куга (НИУ ВШЭ – Санкт-Петербург), Е. А. Кузьмина (ВТБ) Russian Money Market: A Blackboard Model ([Аннотация](http://regconf.hse.ru/uploads/58f10db343dfbf3362e7d3a6af08b3558d6694a1.doc))  В. В. Лакшина (НИУ ВШЭ - Нижний Новгород) Выбор модели для расчета динамического коэффициента хеджирования ([Аннотация](http://regconf.hse.ru/uploads/5e47610213f8cc119c16d6bfebece0c22badd3c8.doc), [полная версия](http://regconf.hse.ru/uploads/83caf2986b5444e73d503711a205ffd75819942f.doc))  Дискуссант: В. А. Лапшин (НИУ ВШЭ) |