**Доклады на конференциях предыдущих лет**

Penikas H., Yevjanov T. "Measuring Technical Efficiency for Banks in the Context of Russian and International Reporting Standards" // Annual MFS Conference (June 29 - July 2, 2014; Multinational Financial Society; Prague, Czech Republic).

Penikas H., Petrova A. "An Empirical Analysis of Growth and Consolidation in Banking: A Markovian Approach for the Case of Russia" // Annual MFS Conference (June 29 - July 2, 2014; Multinational Financial Society; Prague, Czech Republic).

Арзамасов В., Пеникас Г. "Сравнение прогнозной силы интегрального индекса финансовой стабильности, построенного с использованием «обучения» и в его отсутствии: пример Израиля" // XII Всероссийское совещание по проблемам управления, ВСПУ (16-19 июня 2014 г.; ИПУ РАН; Москва). Arzamasov V., Penikas H. "A financial stability index for Israel" // 2nd ITQM Conference (June 4-6, 2014; international Academy of Information Technology and Quality Management; Moscow).

Selmier II, W.T., Penikas H., Vasilyeva K. "Financial Risk as a Good" // 2nd ITQM Conference (June 4-6, 2014; international Academy of Information Technology and Quality Management; Moscow).

Penikas H. Systemically Important Financial Institutions: The Expected Impact of Regulation in Russia // 4th Annual Conference C5: Risk Management in the Russian Banking Sector (May 28-29, 2014; Fitch Analytics; Moscow).

Пеникас Г. "Оценка риска ликвидности при внедрении Базель III: открытые вопросы при внедрении стандартов в России" // ["ЭФФЕКТИВНОЕ КАЗНАЧЕЙСТВО: УПРАВЛЕНИЕ БАНКОМ ВНУТРИ БАНКА"](http://www.msbevent.com/download.php) (10-11 апреля 2014 г.; MSB Events; г. Москва).
Penikas H., Titova Y. [Modeling the Consequences of G-SIB Regulation](http://www.mfsociety.org/modules/modDashboard/uploadFiles/conferences/MCSymposium~159~p18g6pn7trs9c1psn1219rnq12f04.pdf) // Multinational Finance Society Symposium (April 4-5, 2014; Multinational Finance Society; Larnaca, Cyprus).

Арзамасов В. Ю., Пеникас Г. И. "Построение интегрального индекса финансовой стабильности при отсутствии «обучения»: пример Израиля" // XV Апрельская международная научная конференция «Модернизация экономики и общества» (1-4 апреля 2014 г.; НИУ ВШЭ; Москва, Россия).

Пеникас Г. И. "Иерархические копулы в моделировании рыночного риска портфеля акций" // XV Апрельская международная научная конференция «Модернизация экономики и общества» (1-4 апреля 2014 г.; НИУ ВШЭ; Москва, Россия).

Penikas H. "Build up of the Basel 3 framework in Russia" // Russian Subordinated Debt Conference (Jan. 21, 2014; Societe Generale Corporate and Investment Banking; London, UK).

*Сироткин И., Пеникас Г.И.* Моделирование оптимального хеджирующего соотношения с учетом междневного и внутридневного рисков торговых позиций // Первые чтения памяти профессора Б.Л. Овсиевича «Экономико-математические исследования: математические модели и информационные технологии» (21-23 октября 2013; Санкт-Петербургский экономико-математический институт; г. Санкт-Петербург).

*Gomayun N., Penikas H., Titova Y.* Research of Hedging and Trading Derivatives Impact on Public European Banks’ Value and Share Performance: Panel Data Approach // 20th Annual Conference of the Multinational Finance Society (June 30 – July 3, 2013; MFS; Izmir, Turkey).

*Gomayun N., Penikas H., Titova Y.* Research of derivatives as the public European banks value determinant // 3rd International Conference of the Financial Engineering and Banking Society (FEBS) (June 8, 2013; Laboratory of Excellence for Financial Regulation (LabEx-ReFi), ESCP Europe Paris campus; Paris, France).

*Penikas H.* Pan-CIS regulator creation| Benefits from Basel II and III perspectives // [2nd International Banking Conference and Exhibition](http://cisbankers.com/en/events/22?show=previous) (6 июня 2013 г.; CIS Bankers; г. Киев, Украина).

*Пеникас Г.* [Результаты обсуждения рекомендаций по разработки планов самооздоровления в европейском банковском регуляторе](http://download.sap.com/cis/download.epd?context=978DE340DD06EAA23924FA930C0E0E62168AD51171B4C8E370E2877036B9BD25730CD82BB9C082E4159CAE16E7E804299EA5C864B0D3A89C81AECC8DAAF4BF3A0868910E7A69A1F1) // «Вызовы внедрения Базель II и III в российских банках» (28 мая 2013 г.; Финансовый Университет при Правительстве РФ; Москва).

*Merikas A., Merikas A., Penikas H.* Dry Bulk Time Charter Rates Joint Return Distribution Modeling: Copula-Approach // [First International Conference on Informational Technology and Quality Management (ITQM 2013)](http://www.itqm-meeting.org/) (17 мая 2013 г.; Академия наук Китая; г. Суджоу, Китай).

*Пеникас Г.* Стратегическое влияние банковского регулирования: переход от 192-Т к Базель IV // [Конференция «IRB Day»](http://irbday.prognoz.ru/) (25 апреля 2013 г.; Компания «Прогноз»; Москва).

Пеникас Г.И., Сироткин И.Н. [Проблема соотношения доходностей и рисков текущих и срочных инструментов в инвестиционном портфеле](http://www.cemi.rssi.ru/research/seminars/index.php?ELEMENT_ID=6848&sphrase_id=13073) // Семинар «Математическая экономика» (9 апреля 2013 г.; ЦЭМИ РАН; г. Москва).

*Гомаюн Н. И., Пеникас Г. И., Титова Ю.*[Исследование взаимосвязи стоимости публичных европейских банков и характера их операций с деривативами](https://www.hse.ru/adm/edit/%D0%9F%D0%B5%D0%BD%D0%B8%D0%BA%D0%B0%D1%81) // XIV Апрельская международная научная конференция по проблемам развития экономики и общества (3 апреля 2013 г.; НИУ ВШЭ; г. Москва).

*Гомаюн Н. И., Пеникас Г. И., Титова Ю.* [Исследование взаимосвязи стоимости публичных европейских банков и характера их операций с деривативами](http://www.econorus.org/c2013/program.phtml?vid=report&eid=150) // Второй Российский экономический конгресс (19 февраля 2013 г.; Новая экономическая ассоциация; г. Суздаль).

*Пеникас Г.* [Тест на оценку структурного сдвига в одномерных временных рядах на основе моделей «копула»](http://www.econorus.org/c2013/files/vahc.doc) // Второй Российский экономический конгресс (19 февраля 2013 г.; Новая экономическая ассоциация; г. Суздаль).

*Penikas H.I.* “Copula-Based Univariate Time Series Structural Shift Identification Test” // 9th EBES Conference – Rome (January 11-13, 2013; Faculty of Economics, Sapienza University of Rome; Rome, Italy). [Program](http://ebesweb.org/Portals/0/9th%20EBES%20Conference%20Rome%20Program.pdf).
 *Gomayun N., Penikas H., Titova Y.* “Estimate of the Effect of Derivatives Usage by Public European Banks on Its’ Value and Risk” // 9th EBES Conference – Rome (January 11-13, 2013; Faculty of Economics, Sapienza University of Rome; Rome, Italy). [Program](http://ebesweb.org/Portals/0/9th%20EBES%20Conference%20Rome%20Program.pdf).

 *Пеникас Г.И., Савельева А.В.* «Исследование восприятия импортного продовольствия на уровне агрегированных потребителей: случай России и Бразилии, 1992-2020 гг.» // Семинар "Многомерный статистический анализ и вероятностное моделирование реальных процессов" (19 декабря 2012 г.; ЦЭМИ РАН; г. Москва, Россия).

 *Aleskerov F.T., Keskinbaev A.B., Penikas H.I.*“Multiplicative Model of Countercyclical Capital Buffer Evaluation Differentiated by Homogeneous Clusters of Countries” // World Finance and Banking Symposium (December 17-18, 2012; Cheung Kong Graduate School of Business; Shanghai, China). [Conference Proceedings, p. 130](http://www.world-finance-conference.com/sites/default/files/proceding%20with%20ISBN.pdf).

*Алескеров Ф.Т., Кескинбаев А.Б., Пеникас Г.И.* «Мультипликативная модель контрциклического буфера капитала, дифференциированного по группам однородных стран» // [Семинар "Банки и предприятия: модели и рейтинги"](http://www.nes.ru/ru/events/bankseminar) (30 октября 2012 г.; Российская экономическая школа; г. Москва).

*Пеникас Г.И.* [Моделирование операций хеджирования](https://www.hse.ru/data/2012/10/06/1244337304/20121001_PenikasHedging_Final.pdf) // [Финансовая отчетность кредитных организаций: Главные вызовы и задачи финансового директора](http://banking2012.financialreporting.ru/timeline/) (1-2 октября 2012 г.; Quest Partners, г. Москва).

*Penikas H.I.*Copula Models in Banking and Finance. Methodological Issues of Copula Choice: goodness-of-fit versus goodness-of-forecast // Statitstical Models in Business and Finance (August 5-10, 2012; Universtity of St.Thomas, St.Paul, USA): [[Abstract](http://cam.mathlab.stthomas.edu/pdf/ISR/Penikas.pdf)], [[Presentation](http://cam.mathlab.stthomas.edu/pdf/ISR/PenikasW.pdf)].

*Куприянов Ю.В., Пеникас Г.И.* Формальная модель внедрения ИТ проекта: связь организационного, технологического и финансового аспектов // Международная научная конференция «Ломоносов-2012», Секция № 6, «Информационные технологии и системы в стратегии российской организации» (19 апреля 2012 г.; МГУ им. М.В. Ломоносова, Москва, Россия).

*Львов Н., Пеникас Г., Титова Ю.* Моделирование последствий введения регулирования мировых системно значимых банков // Круглый стол «Развитие институтов финансового рынка и регулирование их деятельности» (29 марта 2012 г.; Финансовый Университет, Москва, Россия).

*Penikas H.I.*Position Presentation “LEI Scope, Scale and Initial Ambitions” // Financial Stability Board LEI Workshop (March 28, 2012; Bank for International Settlements; Basel, Switzerland).

*Аншин А.Б., Львов Н.П., Пеникас Г.И.*«Комментарии к проекту Федерального Закона «О внесении изменений в Гражданский кодекс Российской Федерации и другие законодательные акты Российской Федерации (в части развития проектного финансирования)» // Заседание Комитета по финансово-кредитному обеспечению бизнеса (29 февраля 2012 г.; Общероссийская общественная организация «Деловая Россия»; г. Москва).

*Penikas H., Titova Y.* Modeling Policy Response to Global Systemically Important Banks Regulation // Workshop "Russian Banking in the Financial Turmoil: Research Opportunities and New Challenges" (25 ноября, 2011; Центр институциональных исследований, ВШЭ; г. Москва).

*Куприянов Ю. В., Пеникас Г.И.* Оценка эффективности и управление выгодами внедрения информационных систем // Круглый стол «Экономическая эффективность информационных систем» (17 ноября 2011 г.; Московский государственный университет им. М.В.Ломоносова; г. Москва).

*Aleskerov F., Kornev A., Penikas H.I.* Using Differentiated Approach to Countercyclical Capital Buffer Evaluation // Eurasia Business and Economics Conference 2011 (13-15 октября 2011 г.; Университет Загреба; г. Загреб, Хорватия).

Григорьев Д., Кескинбаев А., Львов Н., Никитин А., Пеникас Г. Моделирование нелинейной взаимосвязи между генами на основе функции «копула» // Всероссийская конференция с элементами научной школы для молодежи «Управление научной деятельностью в ВУЗе: международные практики оценки качества НИОКР» (9-10 сентября 2011 г.; Московский физико-технический институт; г. Москва).

*Пеникас Г.И.* [Моделирование паттернов риска системообразующих банков России на основе копулы](http://www.econ.msu.ru/news.php?y=2011#NI1031) // Семинар «Финансовая эконометрика» (4 марта 2011 г.; МГУ им. М.В. Ломоносова, экономический факультет; г. Москва).

*Пеникас Г.И.* Моделирование рисков банковской системы России на основе моделей "копула" в рамках IRB-подхода Базель II // [Семинар «Банки и предприятия: модели и рейтинги»](http://fir.nes.ru/ru/science/Pages/bankseminar.aspx) (23 ноября 2010 г.; РЭШ; г. Москва).

*Пеникас Г.И.* Модели «копула» в управлении рыночным риском российских банков // Научный семинар кафедры «Математика» под руководством проф. С.Е. Степанова (10 ноября 2010 г.; Финансовый Университет при Правительстве РФ; г. Москва).

*Andrievskaya I.K., Penikas H.I., Pilnik N.P.* [How to Deal with Basel II Procyclicality in Russia?](https://www.hse.ru/data/2011/06/20/1215788555/Procyclicality_Russia.pdf) // Eurasia Business and Economics Society (EBES) Conference (28 – 30 октября 2010 г.; EBES; г. Афины, Греция).

*Андриевская И.К., Пеникас Г.И., Пильник Н.П.* Анализ рисков российской банковской системы России в рамках IRB-парадигмы Базель II // Франко-российская научно-практическая конференция ГУ-ВШЭ «Экономика, политика, общество: новые вызовы, новые возможности» (28-29 октября 2010 г.; НИУ-ВШЭ; г. Москва).

*Пеникас Г.И.* [Модели оценки воздействия ИТ проектов на стоимость компании](http://www.hse.ru/data/2010/10/06/1224404443/Penikas.pdf) // Научно-практическая школа-семинар «Управление информационными ресурсами и стоимость компании: междисциплинарный взгляд на ИТ» (1 октября 2010 г.; НИУ-ВШЭ; г. Нижний Новгород)

*Пеникас Г.И.* [Модели «копула»: теоретические основы, практические приложения и открытые вопросы](http://www.mathnet.ru/php/seminars.phtml?option_lang=rus&presentid=1351) // Большой научно-исследовательский семинар кафедры теории вероятностей механико-математического факультета МГУ им. Ломоносова (29 сентября 2010 г.; МГУ; г. Москва).

*Пеникас Г.И.* Прямое и перекрестное хеджирование риска на основе моделей «КОПУЛА» // IX Международная конференция «Применение многомерного статистического анализа в экономике и оценке качества» (25 августа 2010 г.; ЦЭМИ, ГУ-ВШЭ; г. Москва)

*Пеникас Г.И.* Модели "копула" в задачах прогнозирования рисков финансовых рынков // Конференция "Прогнозирование финансовых рынков" (28 мая 2010 г.; Кафедра международных валютно-финансовых отношений ГУ-ВШЭ; г. Москва)

*Penikas H., Brodsky B., Safaryan I.* [COPULA STRUCTURAL SHIFT IDENTIFICATION](https://www.hse.ru/sci/publications/17607164.html) // 3rd Financial Risks International Forum(March 26, 2010; Insitute Louis Bachelier, Europlace Institute of Finance; Paris)

*Пеникас Г.И.* [Модели "копула" в управлении валютным риском банка](http://www.cemi.rssi.ru/activity/seminars/) // Научный семинар "Многомерный статистический анализ и вероятностное моделирование реальных процессов" (17 февраля 2010 г.; ЦЭМИ РАН; г. Москва)

*Пеникас Г.И.*[Применение копул в управлении рисками банков](http://economics.hse.ru/39681/publications/15342309.html) // Первый Российский экономический конгресс (12 декабря 2009 г.; Новая Экономическая Ассоциация; г. Москва)

*Пеникас Г.И.* [Прогнозирование кривой доходности в задачах управления активами и пассивами банка](http://economics.hse.ru/39681/publications/16572122.html) *//* VII-ая Международная школа-семинар "Многомерный статистический анализ и эконометрика" (24 сентября 2008 г.; ЦЭМИ РАН, МШЭ МГУ, Российско-Армянский (Славянский) государственный университет, Армянский государственный экономический университет; п. Цахкадзор, Республика Армения)

*Пеникас Г. И.* [Экспертные методы анализа кредитных рисков](http://www.ipu.ru/semin/so_novik.htm) // Семинар “Экспертные оценки и анализ данных”(9 апреля 2008 г.; ИПУ РАН; г. Москва)