



INŠTITÚT BANKOVÉHO  
VZDELÁVANIA NBS, n.o.

**Pozvánka na seminár**

# **VÝVOJ FINANČNÝCH TRHOV Z POHLADU ŠTATISTIKA**

**Bratislava**

**22. november 2018**

Inštitút bankového vzdelávania NBS, n.o.  
je certifikovaný podľa európskej normy  
systému manažerstva kvality

Inštitút bankového vzdelávania NBS, n.o.  
je členom European Banking and Financial  
Services Training Association



*Inštitút bankového vzdelávania NBS, n.o.  
Vás pozýva na seminár*

# **VÝVOJ FINANČNÝCH TRHOV Z POHLADU ŠTATISTIKA**

## **ÚČASTNÍCI:**

Seminár je určený zamestnancom finančných inštitúcií zaoberajúcich sa riadením rizika, obchodovaním na finančných trhoch a tvorbou portfólia. Predpokladom sú sa základné vedomosti z matematiky a štatistiky.

## **CIEĽ:**

Oboznámiť účastníkov s kvantitatívnou analýzou finančných trhov. Hlavným zameraním je odhad a predikcia štatistických vlastností finančných časových radov, najmä volatility a korelácie cien. Matematické metódy sú aplikované na reálnych finančných údajoch.

## **OBSAH SEMINÁRA:**

- Cena finančných aktív
  - teória náhodných procesov: distribúcia cien, diskretný a spojitý prístup, závislosť v čase
  - empirické vlastnosti: absencia autokorelácií cien, ťažké chvosty, agregáčna normalita atď.
- Volatilita cien
  - pozorovanie: zhlukovanie volatility, asymetrické reakcie
  - modelovanie: historická volatilita, realizovaná volatilita, GARCH modely
  - využitie: riadenie rizika
- Korelácia cien
  - pozorovanie: silná závislosť medzi niektorými aktívami
  - modelovanie: kointegrácia, ARIMA proces, Ornstein-Uhlenbeckov proces
  - využitie: obchodná stratégia „pairs trading“, optimalizácia portfólia

## **LEKTOR:**

Mgr. Vladimír Holý – skúsený odborník na danú problematiku, VŠE Praha

## ORGANIZAČNÉ POKYNY

### TERMÍN KONANIA:

**22. november 2018**

### MIESTO KONANIA:

Inštitút bankového vzdelávania NBS, n. o.  
Tomášikova 28A  
Bratislava - Ružinov

### GARANT PODUJATIA:

Ing. Mario Goliaš  
☎ 02/5787 3541, 0905 436 719  
fax: 02/4363 9314  
e-mail: [mario.golias@nbs.sk](mailto:mario.golias@nbs.sk)

### ČASOVÝ HARMONOGRAM:

prezentácia: **8.45 h – 9.00 h**  
vyučovanie denne: **9.00 h – 16.00 h**

### ÚČASTNÍCKY POPLATOK:

na 1 účastníka bez DPH **197,00 EUR**  
na 1 účastníka vrátane 20 % DPH **236,40 EUR**

**V účastníckom poplatku je zahrnutý obed aj občerstvenie.**

### BANKOVÉ SPOJENIE:

**IBAN:** SK08 0720 0000 0000 0007 4069  
**SWIFT:** NBSB SK BX  
**Variabilný symbol:** 1774  
**Konštantný symbol:** 0308

### CENY UBYTOVANIA:

	<u>cena bez DPH</u>	<u>cena vrátane 20 % DPH</u>
1 noc/ah v budove IBV na Tomášikovej 28A:	26,92 EUR	32,30 EUR

**Presnú objednávku ubytovania prosíme vyznačiť v záväznej prihláške.**

**Vysielajúce organizácie uhradia účastnícky poplatok vrátane požadovaného ubytovania do termínu uzávierky, t.j. 15. novembra 2018,** a priloženú IDENTIFIKÁCIU PLATBY (s názvom podujatia) zašlú ihneď po jeho úhrade na adresu IBV NBS, n. o. Pri prezentácii sa účastníci preukážu kópiou výpisu z účtu. Účastnícky poplatok nie je možné uhrádzať poštovým peňažným poukazom.

### UBYTOVANIE:

Pre mimobratisklavských účastníkov zabezpečíme ubytovanie v rámci našich kapacitných možností v budove IBV NBS, n. o. na Tomášikovej 28A. Účastníci sa môžu ubytovať už deň pred začiatkom podujatia, a to **najskôr po 14.00 h.**

Dovoľujeme si Vás upozorniť, že účastníci, ktorí nie sú zamestnancami NBS, sú povinní preukázať sa pri vstupe do budovy platným občianskym preukazom alebo cestovným pasom.

Na základe všeobecne záväzného nariadenia hlavného mesta SR Bratislavy č. 8/2016 s účinnosťou od 1. januára 2017 o dani za ubytovanie, počínajúc dňom 1. 1. 2017 je IBV NBS, n.o. povinný fakturovať okrem ubytovania aj daň vo výške **1,70 EUR** za fyzickú osobu a prenocovanie. Účastníci, ktorí si budú hradiť ubytovanie v hotovosti, zaplatia súčasne aj túto sadzbu dane na 3. poschodí budovy IBV NBS, n.o.

#### **PODMIENKY ZRUŠENIA ÚČASTI:**

Záväznú prihlášku je možné **stornovať a zmeny** v objednaných službách **sú možné iba písomne**, najneskôr **5 pracovných dní** pred začiatkom podujatia. Zastúpenie účastníka je možné.

Dovoľujeme si Vás upozorniť, že v prípade **nestornovanej záväznej prihlášky si IBV NBS, n.o. vyhradzuje právo vyfakturovať účastnícky v plnej výške.**

#### **DOPRAVA NA MIESTO KONANIA SEMINÁRA A MIESTO UBYTOVANIA (TOMÁŠIKOVA 28A):**

- ❖ z hlavnej železničnej autobusom č. 61, zastávka Trnavská, s prípadným prestupom na autobus č. 50, vystúpiť na zastávke na znamenie Haburská
- ❖ z autobusovej stanice Mlynské nivy autobusom č. 50, zastávka na znamenie Zalužická

Bližšie informácie o mestskej hromadnej doprave v rámci Bratislavy môžete nájsť na stránke <http://www.imhd.sk/ba>.

**Vyplnené a potvrdené záväzné prihlášky zasielajte na e-mailovú adresu:  
mario.golias@nbs.sk, resp. faxom na číslo 02/4363 9314,  
najneskôr do 15. novembra 2018.**

**Prihlásenie je možné aj prostredníctvom online formulára na stránke [www.ibv-nbs.sk](http://www.ibv-nbs.sk).**

Kompletnú ponuku vzdelávacích podujatí Inštitútu bankového vzdelávania NBS, n.o. nájdete na internetovej adrese <http://www.ibv-nbs.sk>.

Tešíme sa na stretnutie s Vami.

doc. Ing. Peter Szovics, PhD.  
riaditeľ  
Inštitút bankového vzdelávania NBS, n. o.