



INŠTITÚT BANKOVÉHO
VZDELÁVANIA NBS, n.o.

Pozvánka na online seminár

REGRESNÉ MODELY PRE RIADENIE RIZÍK

**Bratislava
3. december 2020**

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



REGRESNÉ MODELY PRE RIADENIE RIZÍK

ÚČASTNÍCI:

Seminár je určený všetkým záujemcom o kvantitatívnu analýzu dát, najmä v oblasti riadenia rizík. Je vhodný nielen pre zamestnancov finančných inštitúcií, ktorí si k svojej práci potrebujú osvojiť základné znalosti z regresnej analýzy, či už pre účely odhadu rizika alebo skóringu a predikcií. Základné vedomosti štatistiky sú výhodou.

CIEĽ:

Seminár účastníkov prevedie kvantitatívnu analýzu dát pomocou regresnej analýzy, ktorá je základným stavebným kameňom a najpoužívanejším štatistickým nástrojom (nielen) v oblasti riadenia rizík. Seminár je prakticky orientovaný, avšak účastníci budú oboznámení s najnutnejšou teóriou tak, aby boli schopní štatistickej indukcie – formulovať z empirických poznatkov správne závery a identifikovať výhody a riziká spojené s používaním štatistických modelov. Seminár je síce kurzom základným, napriek tomu reflektuje na súčasnú prax riadenia rizík a umožní účastníkom nahliadnuť a pochopiť prácu analytika/štatistika. V prvej časti sa seminár zameria na klasický regresný model, ktorý má široké uplatnenie vo všetkých oblastiach kvantitatívnej analýzy dát. Ďalšia časť sa venuje príprave dát a výstavbe modelu pre kreditný skóring. V záverečnej časti sa seminár zaoberá ďalšími užitočnými nástrojmi regresnej analýzy, ako je Coxov regresný model pre analýzu prežitia, ako aj klasifikačnými a regresnými stromami pre účely klasifikácie, predikcie a skóringu. Príklady z praxe budú riešené v prostredí Excel, Gretl a R – znalosť uvedených nástrojov sa nepredpokladá.

OBSAH SEMINÁRA:

- Lineárny regresný model
 - metóda najmenších štvorcov
 - autoregresné modely, analýza časových radov, predikcia
 - kvantilová regresia, odhad miery rizika
 - pravdepodobnostný model pre účely skóringu
- Logistický regresný model
 - tradičný prístup k modelovaniu pravdepodobnosti zlyhania (probability of default, PD): výber indikátora zlyhania a jeho prediktorov, transformácia premenných, korelačná analýza, výstavba logistického regresného modelu
 - metóda maximálnej vierohodnosti
 - meranie kvality modelu: Giniho koeficient, ROC krivka
- Coxov regresný model
 - analýza prežitia pre účely riadenia kreditného rizika
- Klasifikačné a regresné stromy
 - ukážky modelov pre klasifikácie, predikcie a skóring

LEKTORKA: Ing. Petra Tomanová, MSc, Vysoká škola ekonomická, Praha

ORGANIZAČNÉ POKYNY

TERMÍN KONANIA:

3. december 2020

GARANT PODUJATIA:

Ing. Mario Goliaš

☎ +421 905 436 719

e-mail: mario.golias@nbs.sk

TECHNICKÁ REALIZÁCIA:

Seminár bude prebiehať on-line cez platformy MS Teams, Zoom alebo Skype, ktoré umožňujú vzdialenú komunikáciu a zdieľanie vysielajúcej obrazovky. Ak účastníci nemajú na PC nainštalovaný MS Teams, Zoom alebo Skype, je možné použiť pripojenie cez web.

Na pripojenie on-line postačuje štandardný web prehliadač a notebook, tablet alebo PC s reproduktormi/slúchadlami a mikrofónom.

Podrobnejšie informácie ohľadom pripojenia a priebehu školenia poskytneme prihláseným účastníkom pred konaním kurzu.

ČASOVÝ HARMONOGRAM:

vyučovanie:

9.00 h – 16.00 h

ÚČASTNÍCKY POPLATOK:

na 1 účastníka bez DPH

241,00 EUR

na 1 účastníka vrátane 20 % DPH

289,20 EUR

BANKOVÉ SPOJENIE:

IBAN:

SK08 0720 0000 0000 0007 4069

SWIFT:

NBSB SK BX

Variabilný symbol: 2138

Konštantný symbol: 0308

KONTAKTNÉ ÚDAJE:

Inštitút bankového vzdelávania NBS, n.o.

Drieňová 1081/31

821 01 Bratislava - Ružinov

IČO: 42166373

DIČ: 2022730369

IČ DPH: SK2022730369

Vysielajúce organizácie uhradia účastnícky poplatok do termínu uzávierky, t.j. 27. novembra 2020, 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.

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.**

Bližšie informácie o podmienkach sa nachádzajú vo Všeobecných obchodných podmienkach na: <http://www.ibv-nbs.sk/O-nas/VOP>.

Vyplnené a potvrdené záväzné prihlášky zasielajte na e-mailovú adresu: mario.golias@nbs.sk najneskôr do 27. novembra 2020.

Prihlásenie je možné aj prostredníctvom online formulára na stránke 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.

Ing. Tomáš Sokol, PhD.

riaditeľ

Inštitút bankového vzdelávania NBS, n. o.