

Norsk Regnesentral innbyr til to kurs

Statistiske metoder for analyse av finansielle data

Mandag 19. mars 2007,
Kl. 9.00-15.00

Totalrisikomodellering og Basel II

Tirsdag 20. mars 2007,
Kl. 9.00-15.00

Gjennom Basel II kan finansinstitusjoner oppnå lavere kapitalkrav hvis de implementerer mer avanserte risikosystemer. Statistisk analyse og modellering er viktige komponenter i alle systemer for å beregne finansiell risiko. Norsk Regnesentral har utstrakt erfaring i statistisk analyse av finansielle data. Gjennom et stort antall prosjekter utført for våre bank- og forsikringskunder har vi opparbeidet kompetanse på hvilke aspekter som er sentrale når man skal modellere finansielle tidsrekker i praksis. Vi har erfart hvilke begreper som er vanskelig å forstå fra en "ikke-statistikers" standpunkt, og har lang trening i å formidle disse på en pedagogisk måte. NRs tidligere kurs for finansbransjen har vært veldig populære med et snitt på rundt 70 deltagere.

Kursene er beregnet på sivil- og sosialøkonomer, aktuarer og andre med kunnskaper i matematikk, statistikk og IT på siviløkonominivå. Mer informasjon om innholdet i de to kursene følger på de neste sidene.



Påmelding innen **1. mars** til Kjersti Aas,
epost: kjersti.aas@nr.no
(husk å angi hvilket kurs du melder deg på)

Pris (inkl. lunsj) for en dag: kr. 5000.

Hvis flere fra samme bedrift, kr. 3500 for en dag fra og med andre deltager.

Hvis samme person deltar på begge dager betales kun kr. 8500 totalt¹

Vi sender faktura. Husk å oppgi fakturaadresse når du melder deg på kurset.

¹ Eksempel: To stykker fra samme bedrift betaler for begge dager totalt $7000+8500=15500$



Statistisk analyse av finansielle data

Innledning: Kursoversikt 09.00 - 09.15

Generell statistikk: Innføring 09.15 - 09.45

Univariate fordelinger 09.45 - 10.45

- Betinget/ikke-betinget fordeling
- Normalfordeling
- Tunghalede og skjeve fordelinger
- Ekstremverdi-fordelinger

Pause 10.45 - 11.00

Monte Carlo simulering 11.00 - 11.30

- Hva er simulering?
- Bootstrapping/historisk simulering
- Praktisk bruk

Regresjon 11.30 - 12.00

- Lineære modeller
- Ikke-lineær regresjon

Lunsj 12.00 - 13.00

Tidsrekkemodeller 13.00 - 13.30

- Hva er en tidsrekkemodell?
- Random walk modeller
- Autoregressive prosesser

Modellering av volatilitet 13.30 - 14.00

- Volatilitet: GARCH-modeller

Pause 14.00 - 14.15

Modellering av avhengighet 14.15 - 15.30

- Korrelasjon
- Multivariate fordelinger/copulas
- Litt om copulas

Avsluttende oppsummering:

- Hva har vi lært ? 15.30 - 15.45



Totalrisikomodellering og BASEL II

Innledning: Kursoversikt	09.00 - 09.15
Modellering av kredittrisiko <ul style="list-style-type: none">• Modeller for PD• Modellering av kredittporteføljer	09.15 - 10.15
Pause	10.15 - 10.30
Modellering av markedsrisiko <ul style="list-style-type: none">• Modellering av indikatorer• Modellering av markedsporteføljer• Inkorporering av styringsregler• VaR og andre risikomål	10.30 - 11.30
Modellering av operasjonell risiko <ul style="list-style-type: none">• Presentasjon av enkel metode	11.30 - 12.00
Lunsj	12.00 - 13.00
Totalrisikomodellering <ul style="list-style-type: none">• Hvilke valg må tas?• Metoder for å aggregere risiko	13.00 - 14.00
Pause	14.00 - 14.15
Fordeling av diversifiseringsgevinsten <ul style="list-style-type: none">• Presentasjon av ulike metoder	14.15 - 14.45
Praktiske eksempler <ul style="list-style-type: none">• Presentasjon av ulike case NR har jobbet med	14.45 - 15.30
Avsluttende oppsummering: <ul style="list-style-type: none">• Hva har vi lært ?	15.30 - 15.45