

Credit Risk v programu R

Datum **1. 12. 2020, 18:00-19:30**

Místo **online: MS Teams**

Cena **Zdarma**

Jaké je riziko, že klient nebude schopen splácen svůj závazek? Jakub Drahoukoupil, odborník z Risk Consultingu v KPMG, vás seznámí s vybranými modely kreditního rizika, které banky nebo úvěrové společnosti využívají pro hodnocení svých klientů. Modelování rizik tímto způsobem probíhá v bankách a je typickou součástí zakázek v konzultantských, auditorských a finančních společnostech.

On-line workshop se bude hodit všem zájemcům o bankovníctví a investice, ale také běžným smrtelníkům, kteří si chtějí vzít úvěr. Je nutné mít nainstalované R Studio a umět ho alespoň základně ovládat.

Jakub Drahoukoupil

V Risk Consultingu pracuje 3 roky, věnuje se převážně vývoji a auditu matematických a statistických modelů v rámci metodiky IFRS 9 a oceňování derivátových nástrojů. Dále pracuje na vytváření specializovaných nástrojů pro regulační reporting, výpočet leasingových smluv podle metodiky IFRS 16 a další. Je expert na VBA, ovládá SQL, R, Python a analytiku. V současné době je doktorandem na VŠE, hraje soutěžně volejbal a rád sportuje.