

Wprowadzenie do R – część 2

W ramach przedmiotu: *Implementacja modeli finansowych*

Adam Wróbel
Risk Modelling & Analytics Specialist



Plan zajęć – UBS

1. 26.02 – Introduction to R, part 1, (Adam)
2. 5.03 – Introduction to R, part 2, (Adam)
3. 12.03 – Simulations in R, part I, (Olga)
4. 19.03 – Simulations in R, part II, (Renato)
5. 26.03 – Pricing path dependent products, (Piotr)
6. 9.04 – PD model development, (Stanisław)
7. 16.04 – PD model validation, (Szymon)
8. 23.04 – Backtesting, part I, (Piotr)
9. 30.04 – Backtesting, part II, (Piotr)

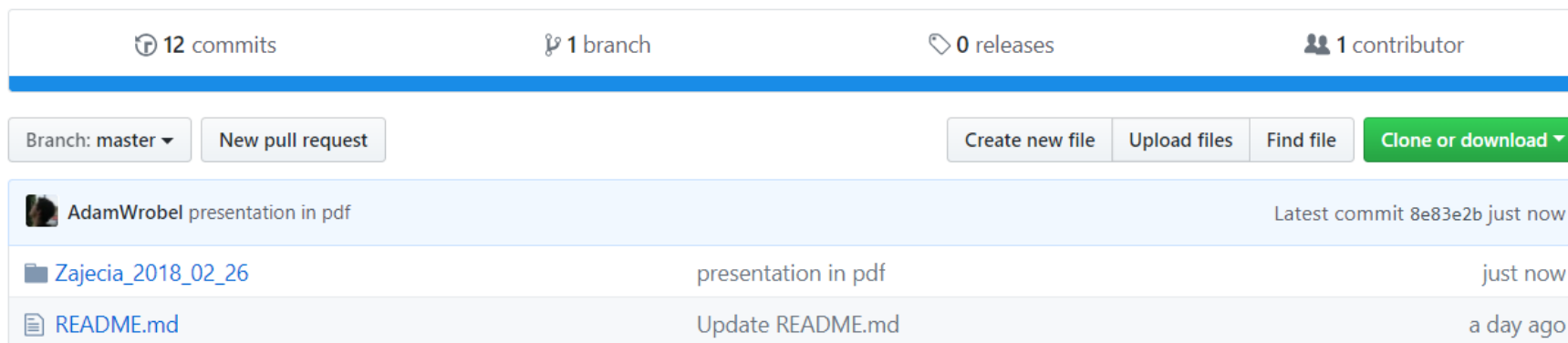
Przejdźmy do kodowania

- Włączmy RStudio



- Materiały, których będziemy używać są dostępne na github pod adresem:

<https://github.com/AdamWrobel/AGH-2018>



- otworzymy skrypt: *wprowadzenie_do_R_czesc_2.R*

Podsumowanie

Nauczyliśmy się:

- Przetwarzać dane wykorzystując dplyr
- Wizualizować dane (base + ggplot2)
- Symulować realizacje zmiennej losowej
- Definiować funkcje
- Pisać pętle

Polecana literatura/materiały do nauki R

- *"Przewodnik po pakiecie R"*, Przemysław Biecek, 2017
- *"R for Data Science"*, Hadley Wickham, Garrett Grolemund, 2017
- *datacamp.com* – wiele dobrych kursów online
- *r-bloggers.com* – interesujące artykuły
- *tryr.codeschool.com* – wprowadzenie do R
- eRka (cykl spotkań krakowskiej społeczności skupionej wokół R):
<https://www.meetup.com/erkakrakow/>

Informacje kontaktowe

Adam Wróbel
adam.wrobel@ubs.com

UBS Business Solutions Center
Risk Modelling & Analytics Specialist

ubs.com/polandcareers