

UBS

R workshops - introduction

Michael-Alexander Ramirez-Sierra
Adam Wróbel



UBS

- Jedna z największych instytucji finansowych na świecie
- Ponad 150 lat historii i doświadczenia
- Główna siedziba firmy jest w Szwajcarii
- Zatrudniamy ponad 60,000 pracowników w ponad 50-ciu krajach
- Działalność firmy koncentruje się na czterech głównych obszarach:
 - zarządzanie majątkiem (wealth management)
 - usługi bankowe w Szwajcarii (private & corporate)
 - zarządzanie aktywami (asset management)
 - bankowość inwestycyjna (investment banking)

Jesteśmy wiodącą globalną instytucją finansową.

R w UBS

- R jest obecnie używany do prototypowania większości modeli
- R jest używany jako środowisko produkcyjne dla wielu modeli:
 - z wyłączeniem modeli związanych z transakcjami na giełdzie
- Inne środowiska/języki, które są silnie obecne: C++, SAS, Matlab

Modelowanie ryzyka w Krakowie



Jesteśmy międzynarodowym zespołem statystyków, matematyków, fizyków i ekonometryków. Ponad połowa z nas, tutaj w Krakowie, jest spoza Polski



Tworzymy środowisko ludzi zafasynowanych modelowaniem, którzy chętnie dzielą się swoją wiedzą



Budujemy i zapewniamy poprawne działanie modeli używanych przez UBS globalnie



Używamy R jako głównego narzędzia do modelowania



Funkcjonujemy w ramach globalnych zespołów z Zurychem, Krakowem i Londynem jako głównymi lokalizacjami

Nasze zespoły:



Credit Risk Methodology



Statistical Risk Aggregation



Market Risk Methodology



Model Validation



Political and Country Risk Methodology

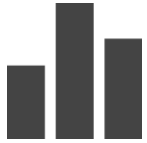
Wybrane modele:



Uogólnione modele liniowe (General Linear Models)



Symulacje Monte Carlo i Kopuły (Copulas)



Modele wartości zagrożonej (Value at Risk)



Modele wyceny instrumentów



Modele ekonometryczne

ubs.com/polandcareers

search for: Internship in Credit Methodology Team (161969BR)

R workshops - introduction

Timeline

1. Introduction & Data Processing (dplyr) [ENG]:

- 06.03.2018, 19:00
- 08.03.2018, 19:15

2. Data Visualization (ggplot2) [PL]

- 13.03.2018, 19:00
- 15.03.2018, 19:15

3. Modelling [PL]

- 19.03.2018, 19:00
- 22.03.2018, 19:15

4. Data Processing (reshape2, purrr) [PL]

- 27.03.2018, 19:00
- 05.04.2018, 19:15

Materials for the workshop

- Open RStudio



- Materials for the workshop are available on:

<https://github.com/AdamWrobel/AGH-R-workshops>

6 commits

1 branch

0 releases

1 contributor

Branch: master ▾




New pull request

Create new file

Upload files

Find file

Clone or download ▾

 AdamWrobel Delete temp	Latest commit 0e05369 7 minutes ago	
 1_introduction_and_data_processing	Delete temp	7 minutes ago
 README.md	Initial commit	10 minutes ago

Materials

Timeline