

Serdecznie zapraszamy studentów i pracowników Wydziału Matematyki, Informatyki i Ekonometrii dnia **14 października 2015 r. o godz. 13:00 w sali 216, bud. A-29** na wykład dr Łukasza Wojciechowskiego z firmy CRISIL Global Research & Analytics pt. *Modelowanie ryzyka operacyjnego*.

Wykład poświęcony zostanie prezentacji firmy CRISIL Global Research & Analytics oraz omówieniu przykładowych projektów biznesowych związanych z modelowaniem ryzyka operacyjnego.

Ryzyko operacyjne to ryzyko straty wynikające z nieodpowiednich lub zawodnych procedur wewnętrznych, błędów ludzi i systemów lub ze zdarzeń zewnętrznych. Obecne było ono od zawsze we wszelkiego rodzaju instytucjach finansowych, jednak dopiero od niedawna rozpoczęto prace nad jego kwantyfikowaniem. Kilka bardzo dotkliwych przykładów sprawiło, że Banki zgodnie zaczęły zabezpieczać się przed tego rodzaju ryzykiem. Na wykładzie pojawią się przykłady strat wynikających z ryzyka operacyjnego oraz opisana zostanie metoda LDA, przy użyciu której można modelować te zjawiska.