

**Program szkolenia**

**Modelowanie ekonometryczne i statystyczne w  
obszarze ryzyka kredytowego –  
– warsztaty z wykorzystaniem MS Excel i Gretl**

**Prowadzący: Aleksandra Babiarz**

1. Model ekonometryczny – wprowadzenie
  - definicja modelu ekonometrycznego
  - najważniejsze etapy budowy modeli
  - analiza korelacji zmiennych i dobór zmiennych do modelowania
2. Model liniowy (case study)
  - metoda najmniejszych kwadratów (MNK)
  - założenia
  - estymacja modelu
  - przykładowe zastosowanie w ryzyku kredytowym
3. Model logitowy (case study)
  - metoda największej wiarygodności (MNW)
  - założenia
  - estymacja modelu
  - przykładowe zastosowanie w ryzyku kredytowym
4. Modele wielorównaniowe (case study)
  - PMNK, 2MNK
  - założenia
  - estymacja modelu
  - przykładowe zastosowanie w ryzyku kredytowym
5. Modele panelowe (case study)
  - definicja
  - metody estymacji
  - przykładowe zastosowania
6. Modele autoregresyjne (case study)
  - definicja
  - metody estymacji
  - przykładowe zastosowania
7. Prognozowanie (case study)
  - metody prognozowania
  - błędy prognoz
8. Praktyczne aspekty modelowania statystycznego i ekonometrycznego (case study)