

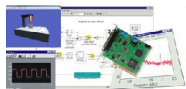


Moderní nástroje pro finanční analýzu a modelování

Česká národní banka, Praha, 9.6.2010



- Založeno v r. 1990, sídlo v Praze
- Produkty a služby v oblasti technických výpočtů, řídicí techniky, simulace dynamických systémů a podnikových procesů
- **MATLAB, Simulink, Stateflow**
 - Inženýrské výpočty, simulace dynamických systémů
 - The MathWorks, Inc.
- **WITNESS**
 - Interaktivní simulace a optimalizace podnikových procesů
 - Lanner Group, Ltd.
- **dSPACE - vývojové systémy**
 - dSPACE GmbH.
- **Comsol Multiphysics**
 - Otevřený systém pro multifyzikální analýzu (metoda konečných prvků)
 - Comsol AB
- **Vývoj vlastního software & hardware**
 - Simulink 3D Animation, Real Time Toolbox, Real-Time Windows Target
 - Měřicí karty
 - Modely pro výuku teorie řízení
- **Paralelní pracovní stanice HeavyHorse**
 - Multiprocessorové stanice pro High-Performance Computing



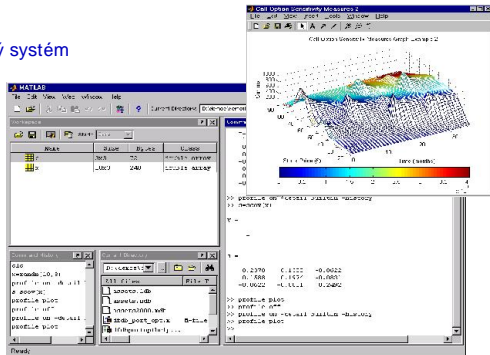


- **Nástroj pro technické výpočty a simulace**

- **původně inženýrský nástroj**

- vyvinul se v univerzálně využitelný otevřený systém

- Interaktivita
- Produktivita práce
- Prověřené algoritmy
- Škálovatelnost
- Interoperabilita
- Otevřenost

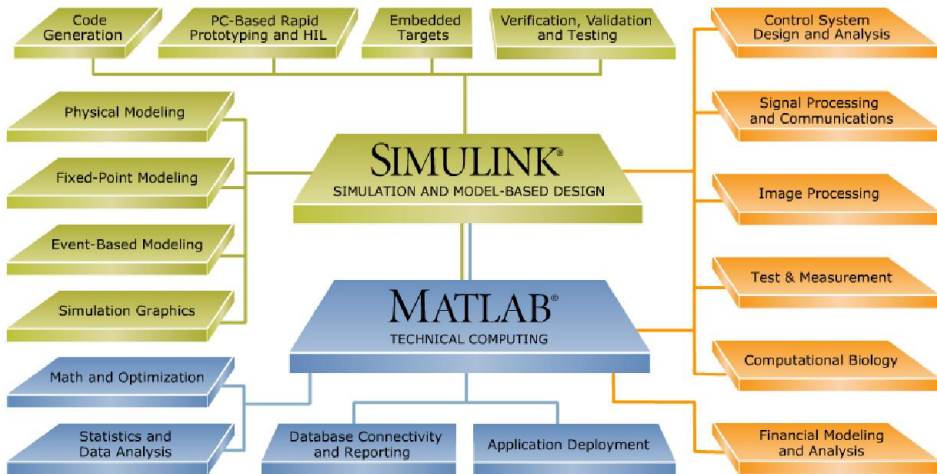


Standard pro práci analytických odborníků a platforma pro výměnu informací a tvorbu uživatelských aplikací v mnoha oborech



Simulink Product Family

Application-Specific Products





Program semináře

- 12:35 Jan Brůha, Česká národní banka
A Macro-Finance Model of the Term Structure: the Case for a Quadratic Yield Model
- 13:00 Paula Poza, MathWorks
Modeling Variable Annuities with MATLAB
- 13:40 Igor Paholok, UniCredit Bank
Modelling of Extremes: Application on Electricity Day-Ahead Spot Prices Time Series
- 14:05 Zbyněk Štokr, Jana Závacká, Ministerstvo financí ČR
DSGE Model of the Czech Republic
- 14:30 Přestávka, občerstvení**
- 15:00 Adam Remo, Martin Cincibuch, CERGE-EI, OGRResearch s.r.o..
Yield Curve Construction and Medium-Term Hedging in Countries with Underdeveloped Financial Markets
- 15:25 Ivona Hrušová, NextFinance, s.r.o.
Profitability of Technical Analysis: Evidence from Central European Stock Markets
- 15:50 Bohdan Vražda, Lukáš Poul, ČEZ a.s., úsek Trading, divize Obchod
Náhled do modelování na velkoobchodních trzích s elektřinou
- 16:15 Petr Havel, Petr Horáček, Eduard Janeček, Centrum apl. kybernetiky, ČVUT FEL a FAV ZČU
Vliv výroby z fotovoltaických elektráren na náklady na řízení přenosové soustavy ČR
- 16:40 Vladislav Páleník, AIF CS, spol. s r.o.
Eliminace rizik ohrožujících prosperity organizace pomocí pojištění přerušení provozu
- 5 17:00 Diskuse a závěr semináře, občerstvení (raut)**