

STATISTICA Data Miner w Krajowym Depozycie Papierów Wartościowych S.A.

O firmie KDPW S.A. jest jedną z głównych instytucji polskiego rynku kapitałowego. Pełni on funkcje depozytu papierów wartościowych oraz izby rozliczeniowej dla wszystkich transakcji rynku regulowanego w Polsce, zarówno kasowego jak i terminowego. KDPW rozlicza także transakcje zawarte poza rynkiem regulowanym. Zadania KDPW obejmują swoim zakresem szeroką gamę usług związanych z rynkiem kapitałowym.

Dlaczego analiza danych Potrzeba wykorzystania zaawansowanych technik analizy danych związana była z koniecznością sprawniejszego tworzenia planów finansowych firmy. Plany te przygotowywane były w oparciu o bardzo szczegółowe dane historyczne, które odnosiły się do wszystkich aspektów działalności firmy. Ponieważ dane te zawierały wiele szeregów czasowych z wartościami rynkowymi z ostatnich lat budowa tylko jednego modelu nie rozwiązywała problemu. Konieczna okazała się budowa kilkunastu modeli szeregów czasowych służących do prognozowania kilkudziesięciu zmiennych, dodatkowo zbudowane modele wymagały comiesięcznej aktualizacji.

Potrzeba częstych aktualizacji prognoz w celu korygowania planów finansowych oraz złożoność projektu skłoniły KDPW do poszukiwania narzędzia, które pozwoliłoby na przyspieszenie i automatyzację działań. Po przeprowadzeniu testów zdecydowano o wyborze do tych celów systemu *STATISTICA Data Miner*.

Rezultaty „Program zaskoczył nas przyjaznym interfejsem. Wszystkie elementy są w nim uporządkowane i łączone strzałkami, co pozwala w łatwy sposób śledzić ścieżki zachodzących procesów. Istotna okazała się także możliwość łączenia, usuwania i skracania szeregów w arkuszach danych, co pozwoliło na uzyskanie jako danych wyjściowych jednego arkusza, zawierającego wyniki wszystkich modeli i znacznie poprawiło automatyzację projektu”.

Dzięki wykorzystaniu środowiska Data Minera możliwe było stworzenie w jednej przestrzeni roboczej kilku a nawet kilkunastu procesów modelowania statystycznego, począwszy od zdefiniowania danych wejściowych, poprzez transformację i/lub czyszczenie danych, konstrukcję modeli a skończywszy na uzyskaniu i prezentacji prognoz. Aktualizacja modeli związana z dokładaniem nowych danych do szeregów odbywała się niemal automatycznie. W przestrzeni roboczej Data Miner wymagała jedynie zaimportowania jednego nowego arkusza z danymi i uruchomienia odpowiednich węzłów.

Dodatkowo na życzenie KDPW konsultanci StatSoft dostosowali funkcjonalność programu tak, aby umożliwić automatyczne generowanie modeli jednocześnie dla wielu zmiennych o podobnych właściwościach statystycznych (takich jak trend i sezonowość), a wyniki były automatycznie zapisywane w formacie Excela.

„Program *STATISTICA*, a w szczególności *STATISTICA Data Miner* zautomatyzował procedury sporządzania prognoz finansowych w naszej firmie, powodując jednocześnie, że ich wykonywanie stało się bardziej przejrzyste i mniej pracochłonne. Dzięki możliwości modelowania tak dużej ilości szeregów jednocześnie nasze prognozy są dokładniejsze a ich prezentacja graficzna jest przyjemna, prosta i efektywna”.

