

-Dokumentation



Zentrum für Informatik ZFI AG

MATLAB Finanzanwendungen (MATF)

<http://www.zfi.ch/MATF>

Weitere Infos finden Sie unter www.zfi.ch oder via Adresse:

**Zentrum für Informatik ZFI AG
Zentralsekretariat
Rütistrasse 28
CH-8952 Zürich-Schlieren
Telefon: 044 732 40 00
Telefax: 041 530 31 68**

Zürich, Basel, Bern, ZÄ¼rich, Schweiz

Titel	MATLAB Finanzanwendungen
Untertitel	Finanzapplikationen mit Matlab
Einleitung	Matlab eignet sich ausserordentlich gut für Applikationen in der Finanzbranche. Das Rechnen mit grossen Datenmengen wird unterstützt. Die Programmierung ist einfach und effizient. Es gibt eine Vielzahl von Statistik-Funktionen und speziell auf Finanzanwendungen zugeschnittene Toolboxes.
Ihr Nutzen	<ul style="list-style-type: none"> - Sie lernen, Matlab für statistische Berechnungen, Risikoberechnung und Optimierungen einzusetzen. - Sie kennen die Leistungsfähigkeit der Funktionen und Toolboxes. Sie haben gesehen, wie moderne Methoden für Value at Risk Berechnung mit Matlab elegant gelöst wurden.
Voraussetzungen	Sie haben Grundkenntnisse in Programmierung, Statistik und Finanzmathematik
Teilnehmerkreis	Finanzmathematiker und Programmierer von Finanzapplikationen, die noch wenig Erfahrung mit Matlab haben.
Unterlagen	<ul style="list-style-type: none"> - Seminar-Ordner - Übungen - Beispiele
Folgekurse	- MATLAB effiziente GUI-Entwicklung (MAGU)
Inhalt	<ul style="list-style-type: none"> - Matlab generell - Matrizenrechnung - Datenim- und -export - Datenvisualisierung - Zufallszahlen - Verteilungsfunktionen - Statistische Funktionen - Statistics and Analysis Asset Prices - Finance-Toolbox - Option pricing - Fixed Income Security Analysis - Portfolio Management und Markowitz Optimization - GARCH Toolbox - Modellierung von Volatilität - Statistic Toolbox - Value at Risk Berechnung (theoretisch und empirisch) - Value at Risk und Portfolio Optimierung - Factor Models für Risk and Return Analysis

Beitrag

Der Teilnehmerbeitrag versteht sich rein netto. Das ZFI ist (gemäss MwSt-Gesetz) nicht Mehrwertsteuerpflichtig und erhebt somit keine MwSt. Bei länger als einen Monat dauernden Lehrgängen ist die Zahlung des Teilnehmerbeitrages in mehreren Raten möglich (pro rata temporis).