



Seminarankündigung

Einführung in Monte Carlo-Methoden und C++ im Financial Engineering

Kursumfang

5 x 8 Stunden Unterricht inkl. Übung.

Veranstaltungszeitpunkt

2.-6. Juli 2007, täglich 9:00 – 12:15 Uhr und 13:45 – 18:45 Uhr

Ort

Frankfurt School of Finance & Management, Raum 7

Dozenten

Christoph Becker, Andreas Weber und Uwe Wystup

Inhalt

- Kurze Einführung in C (Transfer ihrer Basic / Fortran / Pascal o.ä. - Programmierkenntnisse nach C)
- Ausführliche Einführung in das objektorientierte Programmieren mit C++
- Einführung in Templates und die STL
- Grundlegende Monte Carlo – Prinzipien
- Weiterführende Monte Carlo - Techniken zur Berechnung von Greeks und zur Varianzreduktion, Diskretisierungsschemata
- Praktische Aspekte in der Programmierung: Effiziente Implementation, Fehlerbehandlung, numerische Stabilität
- Konzeption einer Klassenbibliothek am Beispiel eines Programmes zur Optionsbewertung unter Verwendung von Design Patterns
- Erstellung von DLLs und Add-ins für Microsoft Excel



Adressaten

Berufseinsteiger im Bereich Financial Engineering,
Studenten im Studiengang „Quantitative Finance“ o.ä.

Benötigte Vorkenntnisse

Gute Kenntnisse in einer beliebigen Programmiersprache, z.B. Pascal, Basic, Fortran etc

Mitzubringen

Ihr eigenes Notebook mit installiertem C++ Compiler. Denkbar sind Borland C++ Builder oder Microsoft Visual Studio. Im Kursmaterial sind zu den Programmbeispielen Projektdateien für VisualStudio 2005 und Gnu Compiler enthalten. Kostenlos stellt Microsoft derzeit Visual C++ Express zur Verfügung.

Teilnehmerzahl

maximal 20

Kosten

1545 EUR,
495 EUR für Studierende der Frankfurt School

Anmeldung

Anmeldungen nimmt Frau Biemer (m.biemer@frankfurt-school.de, Tel 069-154008-734) entgegen. Anmeldeschluss: 18. Juni 2007



Telefax

Frankfurt School of Finance & Management
Marie-Noelle Biemer
Sonnemannstraße 9-11
60314 Frankfurt

Faxnr.: 069-154008-4734

Rückantwort: Anmeldung zum Seminar: Einführung in Monte Carlo und C++ im Financial Engineering / 2.-6.Juli.07

Teilnehmer:

Vorname/Nachname

Straße

PLZ/Ort

Telefon

Telefax

Email

Zum Teilnehmerbeitrag (bitte ankreuzen)

- Euro 1545,-
für externe Teilnehmer
- Euro 495,-
für Studierende der Frankfurt School
Matrikelnr.: _____

Datum

Unterschrift