



ACADEMIA ROMÂNĂ
INSTITUTUL NAȚIONAL DE CERCETĂRI ECONOMICE
„Costin C. Kirițescu”
INSTITUTUL DE PROGNOZĂ ECONOMICĂ

050711, Bucuresti - Romania, Casa Academiei, Calea 13 Septembrie Nr. 13, sector 5
Tel: 40-021-3188106/Ext. 3306; Fax: 40-021-3188148; E-mail: ipe@ipe.ro

Seminar de prezentare a software-ului MATLAB

Institutul de Prognoză Economică organizează **vineri 20 noiembrie 2009**, ora 10.00 un *seminar de prezentare a software-ului MATLAB* cu următoarea tematica:

MATLAB® in Finance – Overview

1. Accessing Data
 - File input/output (xls, csv, special formats, low level i/o)
 - Accessing databases (ODBC/JDBC) – *Database Toolbox*
 - Fetch data from data providers (Yahoo, Bloomberg, Factset, Reuters, Fred etc.) – *Datafeed Toolbox*
2. Numerical Analysis – Toolboxes
 - **Data Analysis:** *Statistics Toolbox, Optimization Toolbox, Genetic Algorithm and Direct Search, Curve Fitting Toolbox, Spline Toolbox*
 - **Computational Finance:** *Financial Toolbox, Econometrics Toolbox, Financial Derivatives Toolbox, Fixed Income Toolbox*
3. Deploying Applications
 - Building Graphical User Interface (GUI)
 - Deploy Executables (.exe) – *Matlab Compiler*
 - Access Matlab capabilities from Excel – *Spreadsheet Link EX*
 - Create Excel Add-in – *Builder EX*
4. Finance Specific Areas and Examples
 - Financial charts (Bollinger, High-Low plot, surface, etc.)
 - Financial time series
 - Portfolio analysis (optimization, risk analysis, effective frontier, hedging etc.)
 - Bond valuation

- Option pricing (Black-Scholes, equity trees, the greeks)
- Performance metrics (Sharpe ratio, Information ratio)
- Simulating equity price, interest rates and pricing options – Monte Carlo simulation of stochastic differential equations
- Fitting/simulating/forecasting ARMAX/GARCH models

Prezentarea va avea loc la Sala de Consiliu a IPE și va fi susținută, în engleză de specialiști ai firmei *Gamax Ltd. din Ungaria* - Szilárd Németh și Fekete Attila.

În speranța că veți răspunde pozitiv acestei invitații vă mulțumim și vă așteptăm cu drag.

Prof.univ.dr. Lucian Liviu Albu, m.c.
Director Institutul de Prognoza Economica,
Tel/fax :0213188148
e-mail : albul@ipe.ro

Dr. Marioara Iordan
Director adjunct Institutul de Prognoza Economica
Tel:0213188106/3322
Fax: 0213188148
e-mail: miordan@ipe.ro