

2020 暑期財務模型 與 FPGA 研討會

主持人

繆維中、盧奕璋、董夢雲

一、研討會主題

◆ 主要參考書籍

- FPGA Based Accelerators for Financial Applications , Christian De Schryver, 2015, Springer.
- 主題一：財務評價理論
 - ✓ Ch1, 10 Computational Challenges in Finance
 - ✓ Ch2, From Model to Application: Calibration to Market Data
- 主題二：FPGA 實作
 - ✓ Ch3, Comparative Study of Acceleration Platforms for Heston's Stochastic Volatility Model
 - ✓ Ch4, Towards Automated Benchmarking and Evaluation of Heterogeneous Systems in Finance

◆ 財金程式庫

- QunatLib , www.quantlib.org 。

二、進行方式

◆ 主題一由財金系同仁說明

- 盡可能說明或提供演算法的細節，以方便實作
- 如有相關的程式庫，可以提供給聽眾

◆ 主題二由電機系同仁說明

- 如有涉及財務的內容，財金系同仁協助說明
- Ch5~Ch11 有關 FPGA 的內容，之後再安排討論

三、研討會時間

- ◆ 主題一：2020/7/28(二), 2020/7/29(三)，14:00~17:00
- ◆ 主題二：2020/8/11(二), 2020/8/12(三)，14:00~17:00

四、研討會地點

- ◆ 台大電機系博理館 114 教室。

五、參與人員

- ◆ 電機人員：
 - 盧奕璋(及研究生)、蕭子凱
- ◆ 財金人員：
 - 董夢雲、繆維中(及研究生)

六、聯絡人員

◆ 董夢雲

- Tel: 0988-065-751
- E-mail: andydong1209@gmail.com
- Line: andydong3137