

Praktikum Quantitative Analyse und Derivate

bei der

Deutschen Postbank AG

Die Abteilung OTC Derivate des Bereichs Treasury der Deutschen Postbank AG sucht zu sofort einen Praktikanten / eine Praktikantin für die Unterstützung bei der Entwicklung von Bewertungsverfahren und Kalibrierungsmethoden.

Hauptaufgabe ist die Implementierung geeigneter Algorithmen zur Bewertung von Aktien- und Zinsderivaten mittels *Stochastischer Volatilitätsmodelle*. Konkret ist das Ziel das Heston Modell um einen Sprungprozess zu erweitern. Dafür werden mittels Fouriertransformation geeignete Darstellungen zur Lösung des Bewertungsproblems für europäische Optionen abgeleitet und implementiert. Dieser Algorithmus wird dann benutzt, um mittels eines geeigneten Optimierungsverfahrens Parameterwerte aus Marktgrößen zu ermitteln. Darüberhinaus sollen dann aufgrund dieser Ergebnisse Monte Carlo Simulationen zur Bewertung komplexer Optionen durchgeführt werden.

Neben dem Studium der relevanten Literatur sollen aufbauend darauf Algorithmen in C++ entwickelt werden und diese dann dokumentiert werden.

Gesucht wird eine Persönlichkeit, die gute Kenntnisse in den Programmiersprachen C++ und Visual Basic vorweisen kann. Außerdem sollte er / sie die Grundlagen der Fouriertransformation und / oder der (globalen) Optimierung kennen.

Für weitere Informationen und Fragen zur Bewerbung wenden Sie sich bitte an:

Dr. Jörg Kienitz
0228 / 920 53140
email: joerg.kienitz@postbank.de