

## Anwendung für die Analyse des Gesamtbank-Cashflows

<b>Kunde / Branche</b>	<b>Europäische Großbank</b>
<b>Projektbeschreibung</b>	<p><b>Anwendung für die Analyse des Gesamtbank-Cashflows</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Erfassung der Gesamtbank-Cashflows</li> <li>• Zusammenfassung der Cashflows und Optimierung mit Zinsderivaten und Bonds</li> <li>• Risiko-Analyse der Cashflows inkl. des Optimierten Hedgeportfolios auf vorgegebenen Zinsszenarien</li> <li>• Berechnung des Value-at-Risk (VaR, CVaR, etc.)</li> <li>• Backtesting der gewählten Strategien anhand von historischen Szenarien</li> </ul>
<b>Leistung</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Konzeption und Entwicklung der Anwendung</li> <li>• Anpassung und Weiterentwicklung der mathematischen Optimierungs- und Analyseverfahren</li> <li>• Implementierung in eine webbasierte Client/Server-Lösung</li> <li>• Release-Management, Tests</li> </ul>
<b>Technologie</b>	Webbasierte Lösung in C#/.Net, MS-SQL
<b>Fachlicher Input</b>	Mathematische Modellierung (VaR, CVaR), Optimierungs-Knowhow
<b>Umfang</b>	1 Berater, 2 Jahre
<b>Tags</b>	ALM, Gesamtbanksteuerung, Cashflow-Optimierung, VaR, CVaR, Hedging, Szenarioanalyse