

## Aufbau von Reporting-Strukturen im Asset-Liability-Management für eine komplexe Bilanzstruktur

<b>Kunde / Branche</b>	<b>Österreichische Bausparkasse</b>
<b>Projektbeschreibung</b>	<p><b>Aufbau von Reporting-Strukturen im Asset-Liability-Management für eine komplexe Bilanzstruktur</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Entwicklung und Aufbau von internen Prozessen</li> <li>• Spezifikation der Ergebnisaufbereitung</li> </ul>
<b>Leistung</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Unterstützung bei der Berechnung, Analyse und Aufbereitung der Delta- und Vega-Risiken, um eine solide ALM-Steuerungsgrundlage zu erlangen und die gewonnenen Daten in Kontext zum aktuellen Marktgeschehen zu stellen</li> <li>• Entwicklung und Aufbau von internen Prozessen, die sich an „best practices“ erfahrener Marktteilnehmer orientieren</li> </ul>
<b>Technologie</b>	Excel, VBA
<b>Fachlicher Input</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Erfahrung mit Analyse und Bewertung von Zinsrisiken und die Implementierung quantitativer Modelle</li> <li>• Kenntnis marktüblicher Modelle und Risikomanagement-Verfahren für die Zinsrisiken von Banken. Erfahrung mit der Entwicklung und Steuerung von Risiko- und Investmentprozessen und von Absicherungsstrategien, besonders im Bereich der nichtlinearen Zinsrisiken (Caps, Floors, Swaptions)</li> <li>• Explizite Erfahrung mit der Entwicklung von Hedging-Strategien mit Zinsoptionen</li> <li>• Praxiserfahrung im Markt für Zinsoptionen und im Risikomanagement von Zinsoptionen</li> </ul>
<b>Umfang</b>	2 Berater, 2-3 Wochen einmalig und laufend
<b>Tags</b>	ALM, Asset-Liability-Management, Zinsrisikosteuerung, Zinsoptionen