

Konzeption und Entwicklung eines Cross-Asset Pricing- und Risikomanagementsystems für komplexe Portfolios auf Basis von Theta-Suite

Kunde / Branche	Beratungsunternehmen (Restrukturierungsberatung)
Projektbeschreibung	<p>Konzeption und Entwicklung eines Cross-Asset Pricing- und Risikomanagementsystems für komplexe Portfolios auf Basis von Theta-Suite</p> <ul style="list-style-type: none"> • Konzeption und Entwicklung und Bereitstellung eines Pricing- und Risikomanagementsystems für die Bewertung und Risikomessung von komplexen Portfolios über alle Assetklassen <ul style="list-style-type: none"> • Rates: CMS, Digital, Single Callable, Multi Callable, Auto Callable, Multitranche, Quanto, Quanto Spread, Quanto Spread Multitranche, Range Accrual, Reverse Floater, Reverse Floater Multitranche, Snowball, Steepener, Steepener TARN, Steepener Wandler, Switchable, Switchable CMS, Volatility Index Linked, GBPCMG, Inflation Linked Structures, Swaps, Swaptions, Caps Floors, Structured Swaps, Structured CCS • Credit: CLN, FTD, CDO², Euro / US ABS, US MBS, Euro RMBS, Euro CMBS, Student Loans, ABS CDO, CRE CDO, US / EUR CLO, LSS, CPDO, TRUPs CDO • Foreign Exchange: European, Asian, Lookback, One Touch / No Touch, Double One / No Touch, Barrier, FX-Linked Hybrid • Equity: European, Asian, Lookback, Rainbow, Digital, Barrier, Equity-Linked Hybrid • Szenarioanalysen von einzelnen Produkte, Produktgruppen und des gesamten Portfolios • Marktdatenaufbereitung und -anbindung • Reportingfunktionalität
Leistung	<ul style="list-style-type: none"> • Vollständige Umsetzung • Testmanagement und Durchführung von Tests • Releasemanagement
Technologie	Theta Suite, MatLab, MS-SQL, Microsoft Excel
Fachlicher Input	Modellentwicklung (Monte-Carlo-Modelle), Produktabbildungen
Umfang	4 Berater, 3 Monate
Tags	Cross-Asset, Restrukturierungsberatung, Derivate, Rates, Equity, Foreign Exchange, Credit