

Konzeption und Entwicklung eines Tools für die Bewertung und das Hedging von inflationsindexierten Mietverträgen

Kunde / Branche	Europäische Großbank
Projektbeschreibung	<p>Konzeption und Entwicklung eines Tools für die Bewertung und das Hedging von inflationsindexierten Mietverträgen</p> <ul style="list-style-type: none"> • Analyse von komplexen Wertsicherungsklauseln in Mietverträgen und Portfolien von Mietverträgen • Abbildung der Cashflows und der teils sehr komplexen Wertsicherungsklauseln mit optionalem Charakter (bspw. Capped Lookback Options) • Aufbau der Marktdatenversorgung (Inflationskurven und – volatilitäten) • Implementierung eines Seasonality-Modells • Berechnung der Barwerte und Optimierung/Ableitung von Hedgingstrategien mit Inflationsderivaten und Portfolien von Inflationsderivaten (Swaps, Caps/Floors, Swaptions) • Simulation in unterschiedlichen Szenarien (historisch, Monte-Carlo) • Ausgabe der Ergebnisse in Tabellen und Graphen
Leistung	<ul style="list-style-type: none"> • Businessanalyse und Entwicklung der Architektur • Modellauswahl und mathematische Weiterentwicklung/Anpassung • Entwicklung und Implementierung in eine eigenständige Anwendung
Technologie	Eigenständige Anwendung in C#/.Net
Fachlicher Input	Inflationsmodelle, Seasonality-Modell
Umfang	4 Monate, 2 Berater
Tags	Inflation, Mietverträge, Wertsicherungsklauseln, Monte-Carlo, Seasonality, Inflation-Swap, Inflation-Options