

Tool für die Konstruktion und die Analyse eines Modellportfolios europäischer Anleihen

Kunde / Branche	Europäische Großbank
Projektbeschreibung	<p>Tool für die Konstruktion und die Analyse eines Modellportfolios europäischer Anleihen</p> <ul style="list-style-type: none"> • Konstruktion eines Modellportfolios auf Basis europäischer Bonds basierend auf einer Datenbank mit Sekundärmarktdaten • Berücksichtigung von makroökonomischer Aspekten und von Relative-Value-Gesichtspunkten • Vergleich der Performance mit der Marktpformance • Wöchentliche Veröffentlichung als Research-Publikation
Leistung	<ul style="list-style-type: none"> • Aufbau einer Excel-basierten Erfassung des Modellportfolios • Entwicklung der Berechnungslogik für die Performance-Kennzahlen • Berechnung von Portfolio-Kennzahlen • Anbindung an die Datenbank mit Sekundärmarktdaten • Anbindung an Marktdaten via Bloomberg und Reuters • Automatisierung des Tabellen- und Chartteils der wöchentlichen Veröffentlichung
Technologie	MS-SQL, Excel
Fachlicher Input	Produkt-Knowhow, Bewertungs-Knowhow, Performancemessung
Umfang	2 Berater, 2 Jahre
Tags	Modellportfolio, Analyse, Research, Europäische Anleihen