

Entwicklung eines Pricing- und Strukturierungssystems (Cross Asset)

Kunde / Branche	Europäische Großbank
Projektbeschreibung	<p>Entwicklung eines Pricing- und Strukturierungssystems für Zins-, Inflations- FX-, Credit- und Commodity-Produkte</p> <ul style="list-style-type: none"> • Implementierung eines Sales-Pricers zur Entlastung der Trading- und Strukturierungs-Desks • Anbindung an eine zentrale Cross-Asset-Quant-Library • Abbildung von Standardprodukten und komplexen Produkten • Entwicklung von Produkt-Templates für die Erfassung • Berechnung von Preisen und Risikokennzahlen • Implementierung von Funktionen für Szenarioanalysen • Automatischer Export von Produkt-Termsheets und Produktinformationsblatt (PIB/KID) • Vernetzung mit Trading- und Strukturierungs-Desks • Automatischer Import der Sales-Trades in das Risikomanagementsystem (Murex) für das Pre- und Post-Deal Processing
Leistung	<ul style="list-style-type: none"> • Produktverantwortung für Softwareprodukt und Projektleitung (fachlicher Chefdesigner / Business Analyst) • Konzeption und Entwicklung der Anwendung und der Schnittstellen • Anbindung an die zentrale Quant-Library, das Risikomanagementsystem (Murex) und weitere interne Systeme • Testmanagement und Durchführung von Tests • Verantwortliches Release-Management • Vorbereitung und Begleitung der Abnahmen durch den Fachbereich • Verantwortlich für die Produktionssicherheit
Technologie	Webanwendung, C#/Net, ASP/Net, Java, Java-Script, J-Query, MS-SQL
Fachlicher Input	Produkt-, Pricing- und Risikomanagement-Knowhow
Umfang	2 Berater, >5 Jahre
Tags	Pricing, Bewertung, Risikomanagement, Szenarioanalyse, Sales, Strukturierung, Trading, Murex, Entwicklung