

## Konzeption und Implementierung von Zins-Kalibrierungsmodellen im Multikurven-Umfeld in ein proprietäres Risiko- und Portfoliomanagementsystem

Kunde / Branche	Softwareentwickler
<b>Projektbeschreibung</b>	<p><b>Konzeption und Implementierung von Zins-Kalibrierungsmodellen im Multikurven-Umfeld in ein proprietäres Risiko- und Portfoliomanagementsystem</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Implementierung der Bewertung von Benchmark-Instrumenten (Deposit, FRA, Swap, FX Forward, Cross-Currency-Swap)</li> <li>• Spezifikation und Implementierung und Test einer generischen Kalibrierungsmethode für Zinskurven (Multikurven unter Berücksichtigung mehrerer Währungen)</li> <li>• Spezifikation und Implementierung einer Excel-basierten Schnittstelle zum Import der Marktdaten</li> <li>• Konzeption und Umsetzung einer grafischen Oberfläche zur Kalibrierung und Validierung von Zinskurven</li> </ul>
<b>Leistung</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Fachspezifikation der Bewertungs- und Kalibrierungsroutinen</li> <li>• Konzeption der grafischen Oberfläche</li> <li>• Implementierung, Test und Dokumentation</li> </ul>
<b>Technologie</b>	C#/.Net, WPF, Excel/VBA, MS-SQL
<b>Fachlicher Input</b>	Bewertung von Benchmark-Instrumenten im Multikurven-Umfeld, Kalibrierung von Zinskurven
<b>Umfang</b>	ca. 200 MT
<b>Tags</b>	Zinskurven, Bootstrapping, Kalibrierung, Multikurven, Swap, FRA, Cross-currency