

Ableitung von Swaption-Skews aus Cap/Floor-Daten und Implementierung der Methodik in ein produktives System unter Verwendung von QuantLib

Kunde / Branche	Hypothekenbank
Projektbeschreibung	<p>Ableitung von Swaption-Skews aus Cap/Floor-Daten und Implementierung der Methodik in ein produktives System unter Verwendung von QuantLib für eine mittelständische Bank</p> <ul style="list-style-type: none"> • Konzeption der Kalibrierung von Swaption-Skews aus Cap/Floor-Volatilitätsflächen • Prototypische Umsetzung • Umfangreiche technische und fachliche Tests der prototypischen Umsetzung • Implementierung der Methodik als C#.Net-Add-In für Excel unter Verwendung von QuantLib • Aufbau eines Kalibrierungsworkflows basierend auf Excel und dem erstellten Add-In
Leistung	<ul style="list-style-type: none"> • Fachkonzeption und –spezifikation • Implementierung des Prototypen in Excel/VBA • Produktive Umsetzung in C#.Net • Technische und fachliche Tests • Dokumentation
Technologie	Excel/VBA, C#.Net, QuantLib, Excel-DNA
Fachlicher Input	Finanzmathematische Erarbeitung der Kalibrierung, fachliche Validierung und Tests
Umfang	ca. 100 MT
Tags	Swaption, Skew, Cap, Floor, Volatilitätsfläche, Kalibrierung, Finanzmathematik, QuantLib