

## Szenariogenerierungs und -analysetool für Finanzzeitreihen (Risikomanagement, Asset-Management, Research)

<b>Kunde / Branche</b>	<b>Europäische Großbank</b>
<b>Projektbeschreibung</b>	<p><b>Szenariogenerierungs und -analysetool für Finanzzeitreihen (Risikomanagement, Asset-Management, Research)</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Markttrisikoanalyse und -simulation von Finanzzeitreihen (Equity, Fixed Income, FX, Indizes)</li> <li>• Methoden: PCA (Principal Component Analysis), Clusteranalyse, Filtertechniken, Monte-Carlo-Simulation, Korrelationsanalyse,</li> <li>• Stochastische Modelle: Brownian Motion, Mean Reversion, Jump-Diffusion</li> <li>• Generieren von pfadabhängigen Szenarien (Zeitreihenpfade) für die Simulation der Portfolioentwicklung <ul style="list-style-type: none"> <li>◦ Anwendungsbereiche: Risikomanagement, Pricing, Asset-Management, Value-at-Risk Berechnung</li> </ul> </li> <li>• Einsatz für dynamische Allokationsstrategien: CPPI, TIPP, Rebalancing von Portfolios</li> <li>• Einsatz im Cross-Asset-Research</li> </ul>
<b>Leistung</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Entwicklung des Fachkonzeptes und Implementierung in eine webbasierte Client/Server-Lösung</li> <li>• Weiterentwicklung und Anpassung der mathematischen Modelle</li> <li>• Release-Management, Testmanagement</li> </ul>
<b>Technologie</b>	Webbasierte Lösung auf Basis von C#/ .NET, SQL-Server
<b>Fachlicher Input</b>	Mathematische Modellierung, Cross-Asset Knowhow
<b>Umfang</b>	1 Berater, 15 Monate
<b>Tags</b>	Brownian Motion, Mean Reversion, Jump-Diffusion, Risikomanagement, Asset Management, Principal Component Analysis, Clusteranalyse, Filtertechniken, Monte-Carlo-Simulation, Korrelationsanalyse