

Aufbau einer Bewertungsbibliothek für Variable Annuities

Kunde / Branche	Deutscher Versicherungskonzern
Projektbeschreibung	<p>Aufbau einer Bewertungsbibliothek für Variable Annuities</p> <ul style="list-style-type: none"> • „Variable Annuities“ sind eine besondere Form der fondsgebundene Rentenversicherung mit einer garantierten Mindestleistung. Die Garantie wird typischerweise durch Derivate dargestellt. Neben einer Rentenzahlung können diese Verträge weitere Leistungen, zum Beispiel Zahlungen im Todesfall garantieren. • Konzeption und Entwicklung eines Frameworks für die Bewertung und die Risikomessung von Variable Annuities • Infrastruktur für fachliche Mitarbeiter, um ohne tiefere Programmierkenntnisse Modelle entwickeln zu können • Anbindung der internen IT (Calypso, Quant Workbench) • Die Software musste in einem "Grid-Umfeld" (Parallelisierung) lauffähig sein
Leistung	<ul style="list-style-type: none"> • Konzeption und Entwicklung des Frameworks • Testmanagement und Durchführung von Tests • Releasemanagement • Abnahmen vom Fachbereich • Produktionssicherheit • Unterstützung des Fachbereiches bei der (Weiter-)Entwicklung von mathematischen Modellen und deren Implementierung für den Fachbereich
Technologie	Java
Fachlicher Input	Produkt-Knowhow, mathematische Modellierung
Umfang	3 Berater, 10 Mannjahre
Tags	Variable Annuities, Sterblichkeit, komplexe Derivate, Calypso,