

Entwicklung und Umsetzung einer Handels- und Absicherungsstrategie unter Einsatz von Zinsderivaten

Kunde / Branche	Deutscher Konzern
Projektbeschreibung	<p>Entwicklung und Umsetzung einer Handels- und Absicherungsstrategie unter Einsatz von Zinsderivaten</p> <ul style="list-style-type: none"> Die heutigen Finanzmärkte unterscheiden sich hinsichtlich Volatilität, Liquidität und Korrelation, vor allem aber hinsichtlich der regulatorischen/politischen Einflussnahme von den Märkten vor der Krise. Risiko/Rendite-Überlegungen werden überlagert, Marktteilnehmer agieren regulatorisch und politisch motiviert. Dadurch leidet die Allokationseffizienz und Risikoprämien in Teilbereichen der Märkte steigen überdurchschnittlich. Das führt zu verzerrten Marktpreisen. Die entwickelte Strategie nutzt diese Ungleichgewichte gezielt mit einfachen Kassa- und Derivatinstrumenten aus. Erfahrene Portfoliomanager analysieren mit quantitativ/statistischen Methoden die Märkte, strukturieren Trades und konstruieren das Portfolio mit technischer Unterstützung nach klaren Investmentprozessen.
Leistung	<ul style="list-style-type: none"> Das Portfoliomanagement entwickelt und strukturiert Relative-Value-Trades, die dann an den Kunden übermittelt und anschließend umgesetzt werden.
Technologie	Proprietäres Market Scanning Tool, Proprietäre Pricing Systeme, Bloomberg VBA, C-Sharp
Fachlicher Input	Markt- und Quant-KnowHow, Portfolio- und Risikomanagementenerfahrung
Umfang	2 Portfoliomanager, 1 Risikomanager, laufend
Tags	Zinsderivate, Arbitrage, Relative Value, Hedging