

Aufbau von Marktdatenplausibilisierungsprozessen und Parameterschätzung für Plausibilisierungstools

Kunde / Branche	Österreichische Finanzgruppe
Projektbeschreibung	<p>Aufbau von Marktdatenplausibilisierungsprozessen und Parameterschätzung für Plausibilisierungstools</p> <p>Analyse von ca. 6000 Datensätzen und Festlegen der Parameter für jeden Datensatz, was eine effiziente Plausibilisierung der Marktdatensätze ermöglicht.</p>
Leistung	<ul style="list-style-type: none"> • Durchsicht der Datensätze und Unterlagen • Historische Analyse der Marktdaten • Gruppierung der Marktdaten • Methodik für Gruppen festlegen • Bestimmung der Parameter mittels statistischer Verfahren • Dokumentation
Technologie	MS Excel, Bloomberg
Fachlicher Input	<ul style="list-style-type: none"> • Erfahrung mit Analyse und Bewertung von Anleihen, Optionen und strukturierten Produkten • Praxiserfahrung in der Erzeugung und Parametrisierung von Marktdatenprozessen für verschiedene Anlageklassen • Kenntnis marktüblicher statistischer Verfahren • Kenntnis der spezifischen Kundenanforderungen
Umfang	1 Berater, 2 Wochen
Tags	Marktdaten, Zinsvolatilitäten, Zinskurven, CDS-Kurven