

Aufbau der Marktdatenversorgung im Bereich Fixed Income (inkl. Optionen) und Anbindung an das Risikomanagementsystem

Kunde / Branche	Österreichische Bank
Projektbeschreibung	<p>Aufbau der Marktdatenversorgung im Bereich Fixed Income (inkl. Optionen) und Anbindung an das Risikomanagementsystem</p> <ul style="list-style-type: none"> • Analyse der vorhandenen Systemlandschaft • Analyse und Auswahl von Marktdatenquellen für Zinskurven und Zinsvolatilitäten • Prototypischer Aufbau der Kalibrierung von Zinskurven und Zinsvolatilitäten gegen 1M-, 3M-, 6M- und 12M-Tenor, dabei insbesondere Entwicklung einer Methodik zur konsistenten Ableitung von Zinsvolatilitätsflächen aus nur partiell verfügbaren Marktdaten • Umsetzung in einen produktiv einsetzbaren Prozess, basierend auf Excel/VBA • Erstellung der Schnittstellen zum Risikomanagementsystem (PMS von much-net) zum Import von Zinskurven und Zinsvolatilitäten
Leistung	<ul style="list-style-type: none"> • Erstellung einer Fachspezifikation zur Kalibrierung von Zinskurven und Zinsvolatilitäten • Erstellung eines Excel/VBA-basierten Prototypen • Analyse des bestehenden Marktdaten-Workflows und Integration der neuen Methodik • Spezifikation und Umsetzung der Schnittstelle zum existierenden Risikomanagementsystem
Technologie	Excel/VBA
Fachlicher Input	Bootstrapping von Zinskurven und Zinsvolatilitätsflächen, Erstellung eines Marktdaten-Versorgungsprozesses für Fixed-Income-Daten
Umfang	40 MT
Tags	Zinskurven, Volatilität, Zinsoptionen, Multikurven, Marktdaten