

## Entwicklung eines Pricing- und Analysesystems für Kreditportfolien und deren Hedging

<b>Kunde / Branche</b>	<b>Europäische Großbank</b>
<b>Projektbeschreibung</b>	<p><b>Entwicklung eines Pricing- und Analysesystems für Kreditportfolien und deren Hedging mit Derivaten für Corporate Treasury Sales</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Erfassung von Kreditportfolien von Firmenkunden und vermögenden Privatkunden</li> <li>• Import der Kundengeschäfte und der Marktdaten aus Front Arena</li> <li>• Erarbeitung von Optimierungsstrategien mit Portfolien von Zinsderivaten</li> <li>• Nachweis der Hedge-Effizienz der ermittelten Optimierungs- und Hedgingstrategien</li> <li>• Szenarioanalysen (Barwert und Cashflow) mit Standardszenarien und individuell konfigurierbaren Szenarien</li> <li>• Historisierung der Marktdaten und Szenarien für die historische Bewertung und Szenarioanalyse an beliebigen Bewertungstagen</li> <li>• Reporting-Funktionalität durch Anbindung an Microsoft-Excel</li> </ul>
<b>Leistung</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Produktverantwortung für Softwareprodukt und Projektleitung (fachlicher Chefdesigner / Business Analyst)</li> <li>• Konzeption und Entwicklung der Anwendung und Schnittstellen</li> <li>• Testmanagement und Durchführung von Tests</li> <li>• Weiterentwicklung von Simulations- und Szenario-Funktionalitäten</li> <li>• Verantwortliches Release-Management</li> <li>• Vorbereitung und Begleitung der Abnahmen durch den Fachbereich</li> <li>• Verantwortlich für die Produktionssicherheit</li> </ul>
<b>Technologie</b>	Rich-Client mit Web-Service, C#/ .Net, MS-SQL-2005, Python
<b>Fachlicher Input</b>	Produkt-Knowhow, Pricing-Knowhow im Bereich Fixed Income
<b>Umfang</b>	4 Berater, >5 Jahre
<b>Tags</b>	Derivate, Hedging, Szenarien, Historie, Sales, Optimierung, Strategie, Front Arena