

## Pricing-Server für Trader im Bereich Financials, Corporates und ABS (Bonds, iTraxx, CDS)

<b>Kunde / Branche</b>	<b>Europäische Großbank</b>
<b>Projektbeschreibung</b>	<p><b>Pricing-Server für Trader im Bereich Financials, Corporates und ABS (Bonds) inkl. Analyse-Tools als Windows-Service</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Pricing von Bonds (Fixed, Float, ABS) inkl. Sensitivitäten</li> <li>• Price, Yield, Asset-Swap-Spread, Benchmark-Spread, Mid-Swap-Spread, TED-Spread, Delta, Modified Duration, Convexity</li> <li>• Aufbau einer Bond-Datenbank für die Speicherung von Stammdaten und Marktdaten (SQL-Server)</li> <li>• Aufbau einer ABS-Datenbank für die Speicherung von Stammdaten und Marktdaten (SQL-Server)</li> <li>• Anbindung der Pricing-Servers an die Marktdatenversorgung (Reuters)</li> <li>• Anbindung an ein Bondhandelssystem</li> </ul>
<b>Leistung</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Übertragung einer existierenden Spreadsheet-Lösung in eine Client/Server-Lösung mit Java-Frontend</li> <li>• Release-Management, Vorbereitung und Durchführung von Tests</li> <li>• Windows-Client für die Stammdatenerfassung</li> </ul>
<b>Technologie</b>	Client/Server-Lösung, C++-DLL, C#.Net, MS-SQL, Reuters-API, Bloomberg-API
<b>Fachlicher Input</b>	Fixed Income Knowhow, Modellierung
<b>Umfang</b>	1 Berater, >4 Jahre
<b>Tags</b>	Bonds, ABS, Fixed Income