

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

Kunde / Branche	Europäische Großbank
Projektbeschreibung	<p>Pricing-Sheets für Trader im Bereich Financials, Corporates und ABS (Bonds, iTraxx, CDS) inkl. Analyse-Tools</p> <ul style="list-style-type: none"> • Pricing von Bonds (Fixed, Float, ABS) inkl. Sensitivitäten • Pricing iTraxx und CDS inkl. Sensitivitäten • Price, Yield, Asset-Swap-Spread, Benchmark-Spread, Mid-Swap-Spread, TED-Spread, Delta, Modified Duration, Convexity • Aufbau einer Bond-Datenbank für die Speicherung von Stammdaten und Marktdaten • Aufbau einer ABS-Datenbank für die Speicherung von Stammdaten und Marktdaten • Anbindung der Pricing-Sheets an die Marktdatenversorgung (Bloomberg und Reuters) • Historisierung der Daten um die Möglichkeit der Analyse von Preis-Zeitreihen zu schaffen • Reporting und Distribution der Rechenergebnisse via Excel und Webbrowser
Leistung	<ul style="list-style-type: none"> • Business-Analyse der Prozesse und des Kundenbedarfs • Entwicklung eines Fachkonzeptes für die Umsetzung • Weiterentwicklung und Implementierung der mathematischen Modelle • Umsetzung in einer C++-DLL mit COM-Anbindung • Implementierung in Microsoft-Excel und Anbindung an die Web-Applikation • Ständige Weiterentwicklung der Anwendung und User-Support vor Ort
Technologie	EXCEL-VBA, C++-DLL mit COM-Anbindung, ASP/.Net
Fachlicher Input	Fixed Income Knowhow, Credit-Derivatives Knowhow, Modellierung
Umfang	1 Berater, >4 Jahre
Tags	Bonds, Credit Derivatives, CDS, iTraxx, ABS