

Konzeption und Implementierung von generischen Markt-Szenarien für alle Marktdatenklassen in ein proprietäres Risiko- und Portfoliomanagementsystem (einschließlich P&L-relevante Implikationen der Szenarien)

Kunde / Branche	Softwareentwickler
Projektbeschreibung	<p>Konzeption und Implementierung von generischen Markt-Szenarien für alle Marktdatenklassen in ein proprietäres Risiko- und Portfoliomanagementsystem (einschließlich P&L-relevante Implikationen der Szenarien)</p> <ul style="list-style-type: none"> • Konzeption und Spezifikation generischer Transformationen zur Erzeugung von Markt-Szenarien • Implementierung generischer Transformationen für Marktdaten • Konzeption und Spezifikation eines Szenario-Generators (inklusive grafischer Oberfläche) zur generischen Eingabe und Verarbeitung von Markt-Szenarien • Implementierung des Szenario-Generators (inklusive grafischer Oberfläche) • Implementierung von üblichen Bilanzierungsmethoden für alle Assetklassen • Konzeption, Spezifikation und Implementierung von Reports zur Ausgabe von P&L-relevanten Implikationen generischer Markt-Szenarien
Leistung	<ul style="list-style-type: none"> • Fachspezifikation der Transformations- und Bewertungsroutinen • Konzeption der grafischen Oberfläche • Implementierung, Test und Dokumentation
Technologie	C#.Net, WPF, MS-SQL
Fachlicher Input	Mathematische Formulierung generischer Transformationen zur Beschreibung von Markt-Szenarien
Umfang	ca. 200 MT
Tags	Marktdaten, Szenario, Transformation, P&L, Buchwert