

Entwicklung eines neuen Marktpreisrisikosystems Phase 1 Value at Risk Kalkulation bei einer G20-Sparkasse

findic

Entwicklung eines neuen Marktpreisrisikosystems

AUSGANGSSITUATION

- Weiter- bzw. Neuentwicklung des Marktpreisrisikomodells
- Ablösung bestehender Excel basierter Lösungen
- Umsetzung aufsichtsrechtlicher Anforderungen (ICAAP)

ROLLE FINDIC

- Aufbau der Infrastruktur für Entwicklung, Test und Produktion
- Abstimmung der Integration MPR 1.0 mit allen relevanten Abteilungen und Dienstleistern
- Unterstützung ETL Entwicklung bei Phase 1 und Holding Integration
- Konzeption und Umsetzung architektonisch kritischer Komponenten bei der GUI, wie MATLAB Schnittstelle und LDAP Anbindung sowie ETL (WM DB)
- Integration der Lösung in den Betrieb

ERGEBNISSE

- Erfolgreicher GoLive am 26.03.2018

