



soluzione:
DeriMod



Per ulteriori info:
Giorgio Canobbio
+39 02 56805501

Perché DeriMod (Derivatives Modelling)?

Il forte processo di innovazione finanziaria, unitamente a sofisticate strategie d'investimento, ha indotto lo sviluppo di strumenti complessi per gestire i rischi finanziari.

L'abilità di costruire e implementare nuove **metodologie di misurazione**, in grado di catturare più realisticamente i movimenti dei prezzi sui mercati, rappresenta il problema centrale della moderna ingegneria finanziaria.

Che cos'è DeriMod?

DeriMod è la soluzione Concentric-Iason per individuare, sviluppare e implementare librerie di pricing per la stima di tutte le principali categorie di strumenti derivati "plain vanilla" e "exotic options".

Il team di ingegneria finanziaria, composto da massimi esperti internazionali nel campo della finanza quantitativa, può sviluppare i più efficaci **frame work di calcolo** per rispondere alle specifiche necessità di investimento o copertura rischi del cliente.

Come viene sviluppato DeriMod?



Advisory strategico: analisi esigenze cliente, analisi e review investment e risk policy, analisi struttura interna, risorse tecniche e tecnologiche, analisi base dati interne e operatività specifiche.



Sviluppo framework di calcolo:

1. identificazione variabili di rischio da stimare;
2. selezione modello rispetto alle variabili di cui al punto 1;
3. sviluppo del modello:
 - scelta della base dati
 - scelta metodologie di analisi dei dati
 - identificazione criticità del modello e loro soluzione
 - scrittura del modello/codice sorgente
 - calibrazione e simulazione
4. check-up diagnostico:
 - analisi risultati del modello, loro correttezza e significatività
 - comparazione valori reali e previsionali del modello
5. analisi di stabilità e comparazione:
 - stress testing del modello
 - comparazione modello con altre soluzioni del mercato
6. supporto per impostazione strategie di copertura.



valori aggiunti: reporting alla direzione, coaching on-the-job, manualistica, manutenzione e aggiornamento soluzione.

Quali sono i vantaggi di DeriMod?

- copertura per tutte le categorie di derivati;
- sviluppo codice sorgente del modello nei principali linguaggi di programmazione;
- *knowledge transfer* specifico tecniche di pricing;
- velocità, snellezza e integrazione della soluzione con le librerie pricing interne;
- team di analisi/sviluppo ai più elevati standard operativi di mercato.

DeriMod è seguito attentamente dagli esperti Concentric-Iason nell'area controllo dei rischi in ambito finanziario.



Fabio Mercurio
Consulente senior, esperto nel design di modelli per il rischio e il pricing



Giorgio Canobbio
Socio fondatore Concentric, esperto in progettazione di soluzioni per il risk management



Antonio Castagna
Consulente senior, esperto nello sviluppo applicativo di modelli per il rischio e il pricing



Concentric S.r.l.
Via Ripamonti 129,
20141 Milan - ITALY

Tel: +39 02 56805501
Fax: +39 02 94435060

info@concentric-italy.com
www.concentric-italy.com

Iason Ltd.
7th floor Hume House,
Ballsbridge
Dublin 4 - IRELAND

info@iasonltd.com
www.isconltd.com