

Erfahrungsbericht

von Martin Schulze und Benjamin Timmermann
bzgl. Umfangreiche Programmierarbeit/Praktikum bei der WestLB

Wir haben vom 25.03.02 bis zum 19.07.02 ein Praktikum respektive eine Werkstudententätigkeit bei der WestLB absolviert. Wir waren in der Abteilung Riskmanagement Support and Controll (RMS&C) eingesetzt. Dieser Bereich gliedert sich zum grössten Teil in folgende Teams auf:

- **Methodenteam:** Dieses entwickelt und prüft Modelle und Verfahren zur handelsunabhängigen Bewertung und Messung von Markt- und Kontrahentenrisiken.
- **Trade-Control:** Die Aufgaben liegen in der Bewertung und Überprüfung ob Handelsgeschäfte zu marktgerechten Preisen abgeschlossen werden, sowie in der Analyse, wie die täglich ermittelten Erträge entstanden sind.
- **Risk Manager für einen Handelsbereich:** Diese analysieren mit Hilfe quantitativer Instrumente wie z.B. Value at Risk (VaR), Stresstests, Delta, Gamma und Vega die Risikoexponierung der Handelspositionen.
- **Support Team für die Market Risk Engine:** Es nimmt die Marktrisikomessung vor und sorgt für die tägliche Bereitstellung der berechneten Ergebnisse.
- **Counterparty Risk:** Dieses Team erarbeite Richtlinien und Prozesse, mit denen die Kreditrisikosteuerung für Handelsgeschäfte in die Kreditrisikosteuerung der Gesamtbank integriert wird. Desweiteren ermittelt es zentral die tägliche Risikoexponierung.
- **IT-Reporting:** siehe untenstehende Ausführungen

Wir waren im Projekt IT-Reporting tätig und haben dort eine Produktioninformationsseite im Intranet der WestLB entwickelt. Das Projekt betreut im wesentlichen die Datenbank MaRiDa (Market Risk Datamart), die die Risikozahlen (z.B. Profit and Lost, Value at Risk) historisch erfasst. Die Erfassung dieser von MPiRE (Market Price Risk Engine) gelieferten Daten findet in sogenannten Runs (z.B. heisst der Hauptrun MiniBatch Run) statt. Das IT-Reporting sorgt ausserdem dafür, dass die Risikozahlen der Bank auf täglicher Basis aufbereitet werden. Diese Zahlen werden dem Vorstand und z.B. den lokalen Risikomanagern in Form von Reports (Tabellen) bzw. Cubes (mehrdimensionale Tabellen die im Intranet zur Verfügung gestellt werden und individuell konfiguriert werden können) bereitgestellt.

Für einige Projekte ist es wichtig zu wissen, wann und ob Reports bzw Cubes generiert worden sind. Die Produktionsseite die wir entwickelt haben gibt eine Übersicht über den täglichen Stand der Runs und der in Folge dieser erzeugten Cubes. Desweiteren wird angegeben welche Daten, die als externe Dateien von den Zweigstellen der WestLB direkt geliefert werden, in den Runs verarbeitet worden sind. Dies ist insbesondere für die Händler wichtig um zu sehen ob Ihre geschickten Daten mit in die Berechnung eingegangen sind.

Am Anfang unserer Tätigkeit mussten wir eine grosse Menge an Information aufnehmen und einordnen. Bis wir mit unserem eigentlichen Projekt anfangen konnten, mussten wir erstmal herausfinden welche Information auf der Internetseite dargestellt werden soll und woher wir diese Information bekommen können. Im Laufe dieses Prozesses mussten wir uns einerseits in die Struktur der Datenbank einarbeiten und andererseits die Tools von Java kennen lernen, die zur Präsentation der Daten notwendig sind. Dafür haben wir uns mit den Servlet Packages und dem SQL Package auseinandersetzt.

Bei Fragen zu Java oder zur Struktur der Datenbank fanden wir immer freundliche Unterstützung im Team. Neben dem eigentlichen Programmieren bestand das Projekt darin eine für den Benutzer leicht verständliche Dokumentation zu verfassen. Das Verfassen dieser Dokumentation hat viel mehr Zeit in Anspruch genommen als wir gedacht haben. Dies war nicht zu vergleichen mit den Entwicklungs-Kommentaren, die man während dem Programmieren im Quelltext einfügt.

Wir haben festgestellt das wir den grossen Einblick in die Abläufe einer Bank nicht mitbekommen konnten. Wir hatten auch die Möglichkeit in andere Bereiche des Riskmanagement hinzuschauen, so konnten wir einen relative guten Eindruck über die Notwendigkeit und Struktur des Risikomanagements bekommen.

Kontakt:

Dr. Marc Ammon
WestLB
Department: 001-25900
Herzogstraße 15
D - 40217 Düsseldorf
Tel.: +49 211 826 6957
Fax: +49 211 826 9247
EMail: Marc_Ammon@WestLB.de

Dr. Benedikt Grosser
WestLB
Department: 001-25900
Herzogstraße 15
D - 40217 Düsseldorf
Tel.: +49 211 826 3036
Fax: +49 211 826 9247
EMail: Benedikt_Grosser@WestLB.de