

Konstantin Holzweissig

ETF Index Portfoliomanager

konstantin.holzweissig@example.de

+49 69 2109 8765

linkedin.com/in/konstantin-holzweissig-etf

Frankfurt am Main, Deutschland

Profil

ETF Index Portfoliomanager mit 6 Jahren Buy-Side-Erfahrung bei BlackRock DACH Frankfurt und Vanguard DACH, Co-PM von 8,4 Mrd. EUR Passive-Index-Fonds inkl. 3,2 Mrd. EUR ESG-ETF. Tracking-Difference durchschnittlich minus 4 bp pro Jahr ueber 24 ETFs (Spitzen-Quartile). CFA Charterholder, CIPM und FRM mit M.Sc. Financial Engineering Frankfurt School.

Berufserfahrung

ETF Index Portfoliomanager

BlackRock Asset Management Deutschland AG

Frankfurt am Main, Deutschland

06/2022 - heute

Co-PM im iShares-DACH-Index-Team (62 Mrd. EUR AuM in iShares-UCITS-Fonds).

- Co-PM fuer 24 iShares-UCITS-ETFs (kumuliert 8,4 Mrd. EUR AuM) inkl. iShares Core MSCI Europe, iShares STOXX Europe 600 und iShares Core MSCI World mit durchschnittlicher Tracking-Difference minus 4 bp pro Jahr (Spitzen-Quartile)
- Rebalancing-Optimierung mit BlackRock Aladdin Aladdin und Charles River IMS, 8.400 Wertpapiere ueber 24 ETFs, 380 Rebalances pro Jahr mit 4 bp durchschnittlichem Market-Impact
- Co-PM iShares MSCI World SRI UCITS ETF (3,2 Mrd. EUR AuM) mit SFDR Article 8 Klassifizierung, Tracking-Difference minus 2 bp ueber 12 Monate
- Implementierung eines KI-gestuetzten Predictive-Trading-Modells in Python (sklearn, riskfolio-lib) zur Reduktion von Implementation-Shortfall um 14 Prozent
- Securities-Lending-Strategie fuer 12 ETFs (kumuliert 4,8 Mrd. EUR AuM), 6 bp Additional-Income pro Jahr ohne Counterparty-Risk-Erhoehung

Fähigkeiten

BlackRock Aladdin + Aladdin Risk

Charles River IMS + State Street Alpha

FactSet Portfolio Analytics + API

Bloomberg Terminal + AIM + PORT

MSCI BarraOne + Index Methodologie

Python (pandas, riskfolio-lib, sklearn)

Tracking-Error + Implementation-Shortfall

Securities Lending + Creation/Redemption

Zertifikate

CIPM Certificate in Investment Performance Measurement

, 06/2023

FRM Financial Risk Manager Charterholder

, 11/2022

Index Portfoliomanager

Vanguard Group Europe, Frankfurt am Main, Deutschland

08/2019 - 05/2022

PM im Vanguard-FTSE-und-MSCI-Index-Team Europe (180 Mrd. EUR AuM in Europe).

- Co-PM Vanguard FTSE Developed World UCITS ETF (4,8 Mrd. EUR AuM in EMEA-Sleeve) mit durchschnittlicher Tracking-Difference minus 3 bp pro Jahr
- Daily Cash-Flow- und Creation-Redemption-Steuerung mit FactSet Portfolio Analytics und Bloomberg Terminal, 28 Mrd. EUR Flow-Volumen ueber 36 Monate
- Aufbau einer Python-Pipeline (pandas, riskfolio-lib) fuer 4 Multi-Index-Optimierungen mit constraint-based Linear Programming und 6 bp Tracking-Error-Reduktion
- Co-Author einer 28-seitigen Whitepaper-Publikation zu Tracking-Error-Quellen in EMEA-ETFs, 4.800 Downloads in 12 Monaten

Portfolio Analytics Specialist

Xtrackers (DWS Group), Frankfurt am Main, Deutschland

10/2017 - 07/2019

Analytics-Specialist im Xtrackers-Index-PM-Team.

- Pflege der Tracking-Difference- und Tracking-Error-Dashboards fuer 84 Xtrackers-UCITS-ETFs (kumuliert 38 Mrd. EUR AuM) mit Power BI und FactSet API
- Unterstuetzung von 6 Senior-PMs bei monatlichen Performance-Attribution-Reviews und 24 Investment-Committee-Decks pro Jahr
- Aufbau eines Securities-Lending-Yield-Reports fuer 28 Equity-ETFs mit 8 bp durchschnittlichem Yield-Beitrag

Ausbildung

M.Sc. Financial Engineering

Frankfurt School of Finance & Management

Frankfurt am Main, Deutschland

10/2015 - 09/2017

Financial Engineering, 1,3

B.Sc. Wirtschaftsmathematik

Karlsruher Institut fuer Technologie (KIT), Karlsruhe, Deutschland

10/2012 - 09/2015

Wirtschaftsmathematik, GPA: 1,4

Projekte

KI-Predictive-Trading-Modell iShares

, 01/2024 - 09/2024

Python (sklearn, riskfolio-lib) Modell zur Reduktion Implementation-Shortfall um 14 Prozent ueber 24 ETFs

Multi-Index-Optimierungs-Pipeline Vanguard

, 06/2021 - 03/2022

Python (pandas) Linear-Programming-Pipeline mit 6 bp Tracking-Error-Reduktion ueber 4 ETFs

CFA Chartered Financial Analyst Charterholder

, 11/2020

CFA ESG Certificate

, 09/2022

DVFA Investmentanalyst CIIA

, 06/2021

Sprachen

Deutsch, Muttersprache

Englisch, C2

Franzoesisch, B2

Publikationen

09/2021,
28-seitige Whitepaper-Publikation, 4.800 Downloads in 12
Monaten

Stärken

Index-Replikations-Präzision

Tracking-Difference minus 4 bp pro Jahr ueber 24 iShares-ETFs (Spitzen-
Quartile) und minus 2 bp im 3,2 Mrd. EUR ESG-ETF

Implementation-Shortfall-Reduktion

KI-Predictive-Trading-Modell reduziert Market-Impact um 14 Prozent ueber
8,4 Mrd. EUR Trading-Volumen pro Jahr

Operative Skalierung

8.400 Wertpapiere ueber 24 ETFs mit 380 Rebalances pro Jahr ohne
Stewardship- oder Compliance-Bearstandungen