

Anne-Sophie Risikomathematik- Stadelmaier



Senior Finanzmathematikerin Aufsicht Internal Models (BaFin)

✉ anne-sophie.stadelmaier@example.de

☎ +49 69 6291 1407

📍 Frankfurt am Main, Deutschland

🌐 anne-sophie-stadelmaier.de

👤 linkedin.com/in/anne-sophie-stadelmaier

📄 ssrn.com/author=stadelmaier

Profil

Senior Finanzmathematikerin bei der Bundesanstalt fuer Finanzdienstleistungsaufsicht BaFin Frankfurt mit M.Sc. Versicherungsmathematik (TUM) und Promotion in Finanzmathematik (Universitaet Frankfurt). 6 Jahre Erfahrung in Modell-Validierung nach SR 11-7 und Solvency II Internal Model Approval Process (IMAP). Verantwortet Validierung von Internal Models fuer 4 deutsche Top-3-Lebensversicherer mit aggregierten Best-Estimate-Reserven von 142 Mrd. EUR.

Berufserfahrung

Senior Finanzmathematikerin Aufsicht Internal Models

10/2022 - heute

Bundesanstalt fuer Finanzdienstleistungsaufsicht BaFin Bonn/Frankfurt
Frankfurt am Main, Deutschland

Senior-Referentin im Geschaeftsbereich Versicherungs- und Pensionsfondsaufsicht VA 1, Spezialgebiet Internal Models

- Lead-Validierung des Solvency-II-Internal-Model der Allianz Lebensversicherung, 38 Mrd. EUR Best-Estimate-Reserve, IMAP-Anhoerung 2025 erfolgreich
- Mitarbeit an der Validierung der Internal Models von 4 Top-3-Lebensversicherern mit 142 Mrd. EUR aggregiertem Reserve-Volumen
- Co-Lead Risk-Committee-Pruefung des FRTB-IMA-Antrags Deutsche Bank, 28 Mrd. EUR Marktrisiko-Buch
- Mit-Verfassen von 6 BaFin-Rundschreiben und 2 Auslegungshilfen zu Solvency II VolAdj und ESG-Generator
- Aktive Mitarbeit in EIOPA Working Group on Internal Models, 4 Vortraege in Paris und Frankfurt 2024

Aktuarin Modell-Validierung

10/2020 - 09/2022

Munich Re Group Muenchen

Muenchen, Deutschland

Aktuarin im Bereich Group Internal Audit, Schwerpunkt Risk Modeling

- Selbst-Validierung des Munich-Re-internen Solvency-II-Modells, 88 Mrd. EUR Reserve, 4 Validierungs-Reports pro Jahr
- Mit-Entwicklung des ORSA-Berichts 2021 und 2022, Vorlage bei BaFin und EIOPA
- Promotionsabschluss zur stochastischen Volatilitaet in ESG-Generatoren, Co-Betreuung durch Munich Re Research
- Vortrag DAV Jahrestagung 2022 Berlin zur Validierung von ESG-Generatoren

Ausbildung

Promotion Dr. rer. pol. Finanzmathematik

10/2017 - 09/2020

Goethe-Universitaet Frankfurt
House of Finance

Frankfurt am Main, Deutschland

Stochastische Finanzmathematik
/ ESG-Modelle

magna cum laude (1,1)

M.Sc.

Versicherungsmathematik

10/2015 - 09/2017

Technische Universitaet
Muenchen (TUM)

Muenchen, Deutschland

Versicherungsmathematik (TUM
Master Versicherungsmath.)

1,2

B.Sc.

Wirtschaftsmathematik

10/2012 - 09/2015

Universitaet Hamburg

Hamburg, Deutschland

Wirtschaftsmathematik

(Schwerpunkt Finanzmathematik)

GPA: 1,3

Projekte

Solvency II Internal Model Approval Allianz Lebensversicherung

10/2024 - heute

Lead-Validierung 38 Mrd. EUR Reserve, mathematische Pruefung Stochastik, Volatilitaets-Adjustment, ESG-Generator

FRTB-Implementierung Deutsche Bank Validierungspruefung

06/2024 - 09/2024

Co-Lead Risk-Committee-Pruefung des FRTB-IMA-Antrags fuer Equity- und Rates-Derivate-Buecher

Publikationen

09/2024

Stadelmaier, A.-S. (2024): Validation criteria for ESG generators under Solvency II

06/2023

Stadelmaier, A.-S. (2023): Stochastic volatility in liability-driven economic scenario generators

Stärken

Modell-Validierungs-Tiefe

Sicherer Umgang mit ESG-Generatoren (G2++, LMM), Black-Scholes-Erweiterungen, Heston-Modellen und P&L-Attribution-Tests

Behoerden-Standpunkt

5 Jahre BaFin-Erfahrung mit IMAP-Anhoerungen, Schriftverkehr nach VAG und BaFin-Erlaeuterungen, dokumentenfest

Internationale Vernetzung

Aktive Teilnahme an EIOPA-Arbeitsgruppen sowie Joint Risk Assessment Forums (JRAFs), 4 Praesentationen in Frankfurt und Paris 2024

Fähigkeiten

Solvency II & ORSA

Bankenaufsichtsrecht (CRR/CRD)

FRTB & SR 11-7 Validierung

Python (statsmodels, pandas)

R, SAS Risk, MATLAB

Moody's Analytics AXIS, AnaCredit

Stochastische Finanzmathematik

Behoerden-Kommunikation

Zertifikate

CERA Chartered Enterprise Risk Actuary (DAV)

06/2024

DAV Aktuar Deutsche Aktuarvereinigung Vollmitglied

11/2022

FRM Financial Risk Manager (GARP)

06/2021

Studienstiftung des Deutschen Volkes Promotionsstipendium

10/2020

Sprachen

Deutsch Muttersprache

Englisch C2

Franzoesisch B2