

# Sebastian Brammer

## Fixed Income Portfoliomanager Investment Grade Credit

Fixed Income Portfoliomanager mit 8 Jahren Buy-Side-Erfahrung bei Union Investment und PIMCO Muenchen, Lead-PM fuer 4,4 Mrd. EUR Euro IG Corporate Bonds und Co-PM eines 1,8 Mrd. EUR Green-Bond-Mandates. 188 bp annualisierte Outperformance gegenueber Bloomberg EUR Aggregate Corporate Index ueber 4 Jahre und Information Ratio 1,4. CFA Charterholder, FRM und DVFA Investmentanalyst CIIA mit M.Sc. Fixed Income Frankfurt School.

✉ sebastian.brammer@example.de  
☎ +49 69 4321 0987  
📍 Frankfurt am Main, Deutschland  
🌐  
📄 linkedin.com/in/sebastian-brammer-  
r-fipm  
📄

### Berufserfahrung

#### Senior Portfoliomanager Euro IG Credit

Union Investment Institutional GmbH

Frankfurt am Main, Deutschland

10/2022 - heute

Lead-PM des Unilinstitutional Euro Corporate Bond Fonds (4,4 Mrd. EUR AuM) und Co-PM eines Green-Bond-Mandates (1,8 Mrd. EUR).

- Lead-Portfoliomanagement Unilinstitutional Euro Corporate Bond (4,4 Mrd. EUR AuM) mit 188 bp annualisierter Outperformance vs. Bloomberg EUR Aggregate Corporate und Information Ratio 1,4 ueber 36 Monate
- Aktive Duration- und Credit-Curve-Positionierung mit Bloomberg AIM, FactSet Portfolio Analytics und MSCI Barra Fixed Income, 384 Emittenten Coverage in IG-Univers
- Co-PM des UniGreenBond Fonds (1,8 Mrd. EUR AuM) mit SFDR Article 9 Klassifizierung, 28 Green-Bond-Emissionen pro Jahr selektiert, 22 Prozent Anteil DACH-Emittenten
- Aufbau eines IFRS-9-ECL-konformen Credit-Migration-Modells in Python (riskfolio-lib, pyfolio) fuer 4,4 Mrd. EUR Buy-and-Hold-Sleeve
- Mandanten-Reviews vor 8 institutionellen Investoren (Versicherer, Versorgungswerke, Stiftungen) mit kumulierten 3,8 Mrd. EUR Commitment, 22 Praesentationen pro Jahr

#### Portfoliomanager High Yield + Crossover

PIMCO Europe GmbH • Muenchen, Deutschland • 07/2019 - 09/2022

Co-PM im European High-Yield-and-Crossover-Team (8,4 Mrd. EUR AuM).

- Co-PM PIMCO Global High Yield Bond Strategy Europe-Sleeve (2,8 Mrd. EUR AuM) mit 1,1 Sharpe Ratio und 244 bp Outperformance vs. ICE BofA Euro HY Constrained
- Coverage von 184 europaeischen HY- und Crossover-Emittenten (BB+ bis B-) mit Bloomberg CRSK, Moody's und S&P Capital IQ Pro Risk Analytics
- Strukturierung von 28 Distressed- und Special-Situation-Trades in 36 Monaten mit kumulierten 480 Mio. EUR Volumen und 22 Prozent IRR auf Distressed-Sleeve
- Aufbau eines KI-gestuetzten Credit-Watchlist-Tools in Python (BERT-NLP auf 8-K-Filings, Bloomberg News Feeds) mit Early-Warning fuer 38 Downgrades
- Personalverantwortung fuer 2 Analysten und 1 Trader, jaehrliche Performance-Reviews und Karriere-Coaching

### Ausbildung

#### M.Sc. Finance

Frankfurt School of Finance & Management

Frankfurt am Main, Deutschland

10/2014 - 09/2016

Fixed Income & Credit Strategy

1,3

#### B.Sc.

#### Wirtschaftsmathematik

Universitaet Mannheim

Mannheim, Deutschland

10/2011 - 09/2014

Wirtschaftsmathematik

GPA: 1,4

### Fähigkeiten

Bloomberg Terminal + AIM + CRSK + PORT

,

FactSet Portfolio Analytics + Fixed Income

,

MSCI Barra Fixed Income Risk + BarraOne

,

Charles River IMS + State Street Alpha

,

Moody's CreditView + S&P Capital IQ Pro

,

Python (pandas, riskfolio-lib, pyfolio)

,

Numerix CrossAsset + Calypso, Duration + Convexity + Credit-Curve-Management

## Credit Research Analyst IG Industrials

Deutsche Asset Management (jetzt DWS)

Frankfurt am Main, Deutschland

09/2016 - 06/2019

Sell-Side-Credit-Analyst im IG-Industrials-Team.

- Credit-Analyse fuer 84 europaeische Industrial-IG-Emittenten (BBB- bis A+) mit Probability-of-Default-Modellen in Bloomberg CRSK und Moody's CreditView
- Vorbereitung von 28 Investment-Memos pro Jahr fuer Credit-Committee mit Buy/Hold/Sell-Empfehlungen, 89 Prozent Hit-Rate auf Buy-Calls ueber 24 Monate
- Mitarbeit bei 14 EUR-Benchmark-Bond-Emissionen (kumuliert 6,8 Mrd. EUR Volumen) als Co-Sponsor mit DWS Capital Markets

## Projekte

### IFRS-9-ECL-Migration-Modell UniInstitutional

- 06/2024 - 12/2024

Python (riskfolio-lib) Credit-Migration-Modell fuer 4,4 Mrd. EUR Buy-and-Hold-Sleeve mit BaFin-MaRisk-Konformitaet

### KI-Credit-Watchlist PIMCO Crossover

- 01/2021 - 09/2021

BERT-NLP-Modell auf Bloomberg News Feeds und 8-K-Filings mit Early-Warning fuer 38 Downgrades, 84 Prozent Hit-Rate

## Zertifikate

### FRM Financial Risk Manager Charterholder

- 11/2023

### DVFA Investmentanalyst CIIA

- 09/2022

### CFA Chartered Financial Analyst Charterholder

- 11/2019

### CFA ESG Certificate

- 06/2022

### ICMA Green Bond Principles Sachverstaendige

- 03/2023

## Sprachen

Deutsch, Muttersprache

Englisch, C2

Franzoesisch, B2

## Auszeichnungen

### Scope Award Beste Euro Corporate Bond Strategie 2024

- 03/2024

UniInstitutional Euro Corporate Bond, Scope Investment Awards Frankfurt

## Stärken

### Credit-Selektion

188 bp annualisierte Outperformance ueber 4 Jahre auf 4,4 Mrd. EUR Fonds und Information Ratio 1,4 mit aktiver Emittenten-Selektion

### Quantitative Tiefe

M.Sc. Fixed Income plus B.Sc. Wirtschaftsmathematik plus Python-Modellbau (Migration-Modell, KI-Credit-Watchlist) im Live-Einsatz

### Sustainable Finance Leadership

Co-PM SFDR Article 9 Green-Bond-Fonds mit 1,8 Mrd. EUR AuM, ICMA Green Bond Principles Sachverstaendige