

FLORIAN LICHTENWALD

JUNIOR PORTFOLIOMANAGER MULTI-ASSET

CONTACT

✉ florian.lichtenwald@example.de

☎ +49 69 8765 4321

🏠 Frankfurt am Main, Deutschland



🌐 [linkedin.com/in/florian-lichtenwald-pm](https://www.linkedin.com/in/florian-lichtenwald-pm)



AUSBILDUNG

M.Sc. Finance

10/2020 - 07/2022

EBS Universitaet fuer
Wirtschaft und Recht

Oestrich-Winkel, Deutschland

Finance 1,4

Auslandssemester

09/2021 - 12/2021

London Business School
(LBS)

London, Vereinigtes Koenigreich

Quantitative Finance 1,5

B.Sc. BWL 10/2017 - 09/2020

Universitaet Mannheim
Mannheim, Deutschland

Betriebswirtschaftslehre

GPA: 1,6

PROFIL

Junior Portfoliomanager mit M.Sc. Finance der EBS Wiesbaden (Note 1,4) und drei Jahren Buy-Side-Erfahrung bei Deka Investment und MEAG Munich Re Asset Management. Co-Verantwortung fuer 1,8 Mrd. EUR Multi-Asset-Teilmandat mit 0,8 Sharpe Ratio und 142 bp Outperformance gegenueber Composite-Benchmark. CFA Charterholder seit 11/2024 mit DVFA Investmentanalyst CIIA und FRM Part I.

BERUFSERFAHRUNG

Junior Portfoliomanager Multi-Asset

02/2024 - heute

Deka Investment GmbH

Frankfurt am Main, Deutschland

Co-Manager im Multi-Asset-Team (28 Mrd. EUR AuM), Fokus auf taktische Allokation und ESG-Integration.

- Co-Verantwortung fuer Deka-MultiManager Balance (1,8 Mrd. EUR AuM) mit 0,8 Sharpe Ratio und 142 bp Outperformance gegenueber 50/50-Composite-Benchmark (MSCI World + Bloomberg EUR Aggregate)
- Taktische Asset-Allokation in Bloomberg AIM ueber 8 Asset-Klassen, monatliches Rebalancing mit 14 Sub-Mandaten (UCITS und Spezialfonds)
- Aufbau eines Python-Faktor-Modells (pandas, sklearn, riskfolio-lib) zur Quality-Momentum-Selektion in MSCI Europe Universe, 84 bp Alpha-Beitrag
- ESG-Integration nach SFDR Article 8 fuer 12 Sub-Fonds (6,4 Mrd. EUR AuM), Sustainalytics-Risk-Rating-Reduktion von 22,4 auf 17,8
- Praesentation der Quartalsergebnisse vor 8 institutionellen Mandanten (Versorgungswerke, Stiftungen) mit kumulierten 480 Mio. EUR Mandat-Volumen

Investment Analyst Fixed Income

08/2022 - 01/2024

MEAG Munich Re Asset Management GmbH

Muenchen, Deutschland

Analyst im Corporate-Bond-Team (38 Mrd. EUR AuM), Coverage IG Industrials und Utilities.

- Fundamentale Credit-Analyse fuer 84 europaeische IG-Emittenten (Industrials, Utilities, Telecom) mit Bloomberg CRSK und Moody's CreditView
- Vorbereitung von 28 Investment-Memos pro Jahr fuer Credit-Committee mit Empfehlung Buy/Hold/Sell auf 4,2 Mrd. EUR Investment-Universer
- Pflege eines DCF- und Probability-of-Default-Modells in Excel mit Power Query, Spread-Backtest mit 92 Prozent Hit-Rate auf Buy-Empfehlungen
- Mitarbeit bei Emission-Roadshows fuer 14 EUR-Benchmark-Bonds (kumuliert 8,2 Mrd. EUR Emissionsvolumen, davon 4 ESG-Bonds)
- Aufbau eines ESG-Engagement-Trackers in Excel mit 38 Issuer-Dialogen pro Jahr, Stewardship-Reporting nach UN PRI

FÄHIGKEITEN

- Bloomberg Terminal + AIM
- + PORT
- FactSet Portfolio Analytics
- Python (pandas, sklearn,
- riskfolio-lib)
- MSCI Barra RiskMetrics +
- BarraOne
- MSCI ESG Manager +
- Sustainalytics
- Refinitiv Eikon +
- Datastream
- Excel + Power Query + VBA
- Performance Attribution +
- Multi-Asset Allocation

ZERTIFIKATE

CFA Chartered Financial
Analyst Charterholder
11/2024

DVFA Investmentanalyst
CIIA
09/2024

FRM Financial Risk
Manager Part I
05/2024

CFA ESG Certificate
11/2023

Bloomberg Market
Concepts (BMC)
06/2023

SPRACHEN

Deutsch	Muttersprache
Englisch	C2
Franzoesisch	B2

PROJEKTE

Quality-Momentum-Faktor-Modell MSCI Europe 06/2024 - 12/2024

Python-Backtest (sklearn, riskfolio-lib) ueber 12 Jahre mit 1,4 Sharpe Ratio, 84 bp
Alpha-Beitrag und 9,8 Prozent Drawdown

ESG-Engagement-Tracker MEAG 02/2023 - 06/2023

Excel + Python Tracker fuer 38 Issuer-Dialoge pro Jahr, Stewardship-Reporting nach
UN PRI und SFDR Article 8 Compliance

STÄRKEN

Quantitatives Fundament

M.Sc. mit Spitzennote und LBS-
Auslandssemester,
eigenständiger Python-Faktor-
Modell-Bau mit Live-Alpha-
Beitrag im Multi-Manager-Fonds

Mandanten-Nähe

Präsentation vor 8
institutionellen Mandanten in 18
Monaten, Versorgungswerke und
Stiftungen mit 480 Mio. EUR
kumuliertem Mandat-Volumen

ESG-Integration

Implementierte SFDR Article 8
Konformität für 6,4 Mrd. EUR
AuM und reduzierte
Sustainalytics-Risk-Rating um
4,6 Punkte