

MAXIMILIAN LIQUIDITY-RISK- BRUNNER

SENIOR MARKET RISK MANAGER TRADING / FRM
/ CFA / PRM

CONTACT

✉ maximilian.brunner@example.de

☎ +49 69 7788 9900

🏠 Frankfurt, Deutschland



🌐 [linkedin.com/in/maximilianbrunner](https://www.linkedin.com/in/maximilianbrunner)



AUSBILDUNG

M.Sc. Finanzmathematik

10/2014 - 09/2016

Universitaet Ulm

Ulm, Deutschland

Finanzmathematik 1,0

Diplom Mathematik

10/2011 - 09/2014

Universitaet Ulm

Ulm, Deutschland

Mathematik mit
Schwerpunkt

Versicherungsmathematik

GPA: 1,3

PROFIL

Market Risk Manager Trading mit Diplom Mathematik (Ulm) und 7 Jahren Erfahrung im Markt- und Counterparty-Risiko bei Deutsche Bank AG Frankfurt Risk Investment Bank und Numerix Consulting. FRM-Vollmitglied, CFA Charterholder. Verantwortet VaR-Limits fuer 18 Trading-Desks und EUR 240 Mrd. Trading-Book. Deutsch C1, Englisch C2.

BERUFSERFAHRUNG

Senior Market Risk Manager Trading 10/2021 - heute

Deutsche Bank AG Frankfurt Risk Investment Bank Frankfurt, Deutschland

Senior Market Risk Manager Investment Bank Trading

- Verantwortet VaR-Limits und Stresstest-Limits fuer 18 Trading-Desks und EUR 240 Mrd. Trading-Book
- FRTB Standardised Approach fuer alle 18 Desks bis Q4 2024 implementiert, RWA-Impact EUR 4,8 Mrd. quantifiziert
- Backtesting-Genauigkeit ueber 4 Jahre bei 97%, 14 Exceptions sauber an BaFin gemeldet ohne Modellaustausch
- XVA-Modell-Updates fuer Counterparty Credit Risk in Calypso, CVA-Reduktion EUR 180 Mio.
- Tagliche Floor-Praesenz mit Senior Traders, 4 Limit-Exception-Calls pro Tag im Schnitt

Risk Consultant 10/2017 - 09/2021

Numerix Consulting Frankfurt Frankfurt, Deutschland

Risk Consultant in der Buy-Side Risk-Implementation Practice

- Numerix CrossAsset und Oneview Rollouts fuer 6 deutsche Banken und 4 Versicherer
- Konfiguration von 240 Pricing-Modellen fuer FX, Rates und Equity Derivatives
- BaFin-MaRisk-Compliance-Reviews fuer Numerix-Implementierungen bei 3 Mandanten

FÄHIGKEITEN

- VaR + Expected Shortfall +
- FRTB
- MSCI Barra RiskMetrics +
- BarraOne
- Bloomberg Terminal +
- PORT + MARS
- Numerix CrossAsset +
- Murex MX.3
- Python (numpy, scipy, jax,
- riskmetrics)
- Algorithmics + OpenLink
- Findur
- FX + Rates + Equity +
- Credit Derivatives
- Stresstest + Backtesting +
- Limits-Setting

ZERTIFIKATE

CFA Charterholder 11/2022

FRM (GARP) -
Vollmitglied
06/2020

PRM Professional Risk
Manager (PRMIA)
03/2022

MSCI BarraOne Certified
Practitioner
10/2023

Numerix CrossAsset
Certified
02/2024

SPRACHEN

Deutsch Muttersprache
Englisch C2
Franzoesisch B2

PROJEKTE

FRTB SA Implementierung Deutsche Bank 03/2024 - 09/2024

Standardised Approach fuer 18 Trading-Desks, Go-Live Q4 2024, RWA-Impact EUR
4,8 Mrd. quantifiziert

PUBLIKATIONEN

11/2024

STÄRKEN

Trading-Floor-Praesenz

Sitze taeglich neben Senior Traders auf dem Frankfurt-Floor, klaere Modell-Fragen unter Marktdruck in Echtzeit

Modell-Tiefe in Derivaten

Verantwortete Modelle fuer 6 Derivate-Kategorien inklusive XVA, CCP-Margin und Collateral-Optimierung

Backtesting-Disziplin

Fuehre tagliches Backtesting fuer 18 Desks mit 250-Tage-Window, Backtesting-Genauigkeit ueber 4 Jahre bei 97%