

Helena Eichinger

Multi-Asset Portfoliomanagerin

Multi-Asset Portfoliomanagerin mit 7 Jahren Buy-Side-Erfahrung bei MEAG Munich Re Asset Management und Allianz Global Investors Muenchen, Lead-PM eines 3,6 Mrd. EUR institutionellen Multi-Asset-Mandats fuer Versicherungs-ALM. 142 bp annualisierte Outperformance gegenueber Composite-Benchmark, Sharpe Ratio 1,1 und Sortino Ratio 1,8 ueber 5 Jahre. CFA Charterholder, CAIA, DVFA Vermoegensverwalter und M.Sc. Quantitative Finance Mannheim.

✉ helena.eichinger@example.de
☎ +49 89 3210 9876
📍 Muenchen, Deutschland
🌐 [linkedin.com/in/helena-eichinger-mapm](https://www.linkedin.com/in/helena-eichinger-mapm)
📄

Berufserfahrung

Lead Multi-Asset Portfoliomanagerin

MEAG Munich Re Asset Management GmbH

Muenchen, Deutschland

08/2022 - heute

Lead-PM des MEAG Multi-Asset Insurance Solution Fonds (3,6 Mrd. EUR AuM) und Co-PM dreier ALM-Spezialmandate.

- Lead-Portfoliomanagement MEAG Multi-Asset Insurance Solution (3,6 Mrd. EUR AuM) mit 142 bp annualisierte Outperformance vs. Custom-Composite (60/30/10 MSCI World / Bloomberg EUR Aggregate / FTSE EPRA NAREIT) ueber 5 Jahre
- Strategische und taktische Asset-Allokation in BlackRock Aladdin und Bloomberg AIM ueber 14 Asset-Klassen inkl. Private Equity (6 Prozent), Infrastructure Debt (8 Prozent) und Hedge Funds (4 Prozent)
- Aufbau eines Solvency-II-Optimierungs-Frameworks in Python (riskfolio-lib, scipy) fuer 3 ALM-Mandate (kumulierte 4,8 Mrd. EUR Reserven), SCR-Reduktion 348 Mio. EUR ueber 24 Monate
- ESG-Integration nach SFDR Article 8 und EU Taxonomie ueber alle 14 Asset-Klassen, Carbon-Intensity-Reduktion 18 Prozent in 24 Monaten
- Team-Verantwortung fuer 3 PM-Associates und 2 Analysten, monatliche Investment-Committee-Vorsitz mit 18 Vorlage-Entscheidungen

Portfoliomanagerin Tactical Asset Allocation

Allianz Global Investors GmbH • Muenchen, Deutschland

09/2019 - 07/2022

Senior PM im Multi-Asset-Tactical-Team (12 Mrd. EUR AuM).

- Co-PM AllianzGI Multi Asset Plus (2,4 Mrd. EUR AuM) mit 184 bp Outperformance vs. 50/50-Composite-Benchmark ueber 3 Jahre
- Pflege eines 18-Faktor-Macro-Modells in FactSet Portfolio Analytics + MSCI BarraOne mit monatlichem Asset-Allokations-Tilting (Equity, Duration, Credit, Commodity)
- Implementierung eines KI-gestuetzten Regime-Switching-Modells in Python (sklearn, hmmlearn) zur Volatility-Forecasts auf MSCI World und Bloomberg EUR Aggregate
- Mandanten-Reviews mit 6 Versorgungswerken und 4 Stiftungen (kumuliert 6,4 Mrd. EUR Commitment), 28 Praesentationen pro Jahr

Junior Portfoliomanagerin Multi-Asset

DWS Investment GmbH • Frankfurt am Main, Deutschland

11/2017 - 08/2019

Junior PM im Multi-Asset-Wealth-Team.

- Co-Pflege des DWS Concept Kaldemorgen (Volumen 12,4 Mrd. EUR AuM zu Hoechstzeit) mit Fokus auf Tail-Risk-Hedging und Long-Volatility-Strategien
- Aufbau eines Volatility-Strategy-Backtests in Python (pyfolio, empyrical) ueber 14 Jahre VIX-Future-Daten, 1,4 Sharpe Ratio Live-Strategie
- Mitarbeit bei 18 institutionellen Pitch-Meetings vor Versorgungswerken und Stiftungen mit kumulierten 4,2 Mrd. EUR Mandat-Volumen

Ausbildung

M.Sc. Quantitative Finance

Universitaet Mannheim

Mannheim, Deutschland

10/2015 - 09/2017

Quantitative Finance • 1,2

MBA Auslandssemester

INSEAD

Fontainebleau, Frankreich

01/2016 - 06/2016

MBA Exchange Finance • 1,4

B.Sc.

Wirtschaftsmathematik

Universitaet zu Koeln

Koeln, Deutschland

10/2012 - 09/2015

Wirtschaftsmathematik

GPA: 1,4

Fähigkeiten

BlackRock Aladdin + Aladdin Wealth + eFront

,

Bloomberg Terminal + AIM + PORT + BQuant

,

FactSet Portfolio Analytics + Multifactor Risk

,

MSCI BarraOne + RiskMetrics + Climate Lab

,

Charles River IMS + State Street Alpha

,

Python (pandas, riskfolio-lib, scipy, sklearn)

,

Numerix CrossAsset + Calypso, Solvency II SCR + ALM Modeling

Projekte

Solvency-II-Optimierungs-Framework MEAG

- 03/2024 - 12/2024

Python (riskfolio-lib, scipy) Konvex-Optimierung fuer 3 ALM-Mandate, SCR-Reduktion 348 Mio. EUR ueber 24 Monate

KI-Regime-Switching-Modell AllianzGI

- 06/2021 - 03/2022

Python (sklearn, hmmlearn) Hidden-Markov-Modell fuer Volatility-Forecasts auf MSCI World, Live-Einsatz im 2,4 Mrd. EUR Fonds

Zertifikate

DVFA Vermoegensverwalter VV CIIA

- 06/2023

CAIA Chartered Alternative Investment Analyst

- 09/2021

CFA Chartered Financial Analyst Charterholder

- 11/2020

CFA ESG Certificate

- 09/2022

Solvency II Practitioner DAV

- 06/2024

Sprachen

Deutsch, Muttersprache

Englisch, C2

Franzoesisch, C1

Italienisch, B2

Auszeichnungen

Scope-AAA-Rating MEAG Multi-Asset Insurance

- 06/2024

Scope Investment Awards Frankfurt, Top-Rating fuer Multi-Asset-Insurance-Solution-Fonds

Stärken

Cross-Asset-Allokation

Aktive Steuerung ueber 14 Asset-Klassen inkl. Private Equity, Infrastructure Debt und Hedge Funds mit 142 bp Outperformance

Quantitative Modellierung

M.Sc. Quantitative Finance plus Python-Hands-On (Solvency-II, Regime-Switching, Tail-Risk-Hedging) im Live-Einsatz

Solvency-II-Expertise

Solvency II Practitioner DAV mit 348 Mio. EUR SCR-Reduktion fuer 3 Versicherungs-ALM-Mandate