

STEFAN QUANT- AICHINGER

✉ stefan.aichinger@example.de

☎ +49 69 9100 4810

📍 Frankfurt am Main, Deutschland

🌐 stefan-aichinger.quant

🌐 linkedin.com/in/stefan-aichinger-quant

📄 github.com/saichinger-quant

FÄHIGKEITEN

- Stochastische Finanzmathematik
- Derivate-Pricing (Equity, FX, Rates)
- C++17 (QuantLib, BLAS, MKL)
- Python (numpy, pandas, jax)
- Bloomberg Terminal & Refinitiv
- Eikon
- Murex MX.3 & Numerix CrossAsset
- KX kdb+ Time-Series-DB
- Risikomanagement & VaR

ZERTIFIKATE

CFA Level III bestanden, Charter-Holder Status (Member CFA Society Germany)

- 11/2024

FRM Financial Risk Manager (GARP)

- 06/2023

CQF Certificate Quantitative Finance, Distinction

- 11/2021

Studienstiftung des Deutschen Volkes Stipendium

- 09/2019

PROFIL

Senior Quantitative Analyst im Equity-Derivate-Quant-Team von Deutsche Bank AG Frankfurt mit 6 Jahren Erfahrung in Pricing und Hedging exotischer Optionen. M.Sc. Finanzmathematik Universität Ulm (1,1) und CQF mit Distinction. Verantwortet ein Notional-Buch von 18 Mrd. EUR und reduzierte die durchschnittliche Pricing-Latenz um 64 % durch C++-Vektorisierung und CUDA-Migration.

BERUFSERFAHRUNG

Senior Quantitative Analyst Equity Derivatives

Deutsche Bank AG Frankfurt (Risk + Quant Team)

Frankfurt am Main, Deutschland

10/2022 - heute

Senior Quant im Equity-Derivate-Quant-Team

- Pricing- und Risiko-Verantwortung fuer ein Notional-Buch von 18 Mrd. EUR (Equity-Barrier-Optionen, Autocallables, Variance Swaps)
- Implementierung eines Local-Stochastic-Volatility-Modells in C++ mit QuantLib, P&L-MAE auf 2,4 % reduziert
- Migration von 14 Pricing-Modellen auf CUDA, durchschnittliche Pricing-Latenz von 380 ms auf 138 ms reduziert (64 % Verbesserung)
- Co-Verantwortung fuer SR 11-7 Modell-Validierung mit Risk-Management, 4 Modelle 2024 genehmigt
- Co-Mentor fuer 2 Junior-Quants und 1 Praktikant im Frankfurter Quant-Team

Quantitative Analyst Rates Derivatives

Goldman Sachs Frankfurt • Frankfurt am Main, Deutschland

10/2019 - 09/2022

Quant im Rates-Derivate-Team

- Entwicklung eines Hull-White-Two-Factor-Modells fuer Bermudan Swaptions, Pricing-Spread um 14 bps reduziert
- Aufbau einer Python-Pricing-Bibliothek (numpy, jax), produktiv genutzt von 28 Sales-Tradern
- Co-Autor einer internen Goldman-Research-Note zur SOFR-Replikation nach LIBOR-Wegfall
- Validierung von 6 Marktrisiko-VaR-Modellen unter FRTB, Approval durch Risk-Committee Q3 2021

SPRACHEN

Deutsch • Muttersprache

Englisch • C2

Franzoesisch • C1

PUBLIKATIONEN

10/2024 •

Aichinger, S. (2024): Calibration techniques for SABR with negative rates - a market practitioner view

STÄRKEN

Quantitative Tiefe

Verstehe und implementiere Heston, SABR und LSV-Modelle aus dem Papier in C++ mit P&L-validierter Genauigkeit unter 3 % MAE

Latenz-Optimierung

Verbesserte Pricing-Latenz von 380 ms auf 138 ms durch Eigen3 Vektorisierung und CUDA-Migration einzelner Knoten

Cross-Asset-Bruecke

Quantitative Verantwortung ueber Equity-, FX- und Rates-Derivate hinweg, regelmaessige Praesentation an Risk-Committee

AUSBILDUNG

M.Sc. Finanzmathematik (Master Versicherungs- und Finanzmath.)

Universitaet Ulm Institut fuer Versicherungs- und Finanzmathematik

Ulm, Deutschland

10/2017 - 09/2019

Finanzmathematik (Schwerpunkt Stochastische Modelle) • 1,1

B.Sc. Mathematik

Technische Universitaet Muenchen (TUM)

Muenchen, Deutschland

10/2014 - 09/2017

Mathematik (Schwerpunkt Stochastik) • GPA: 1,3

PROJEKTE

FX-Barrier-Option Smile-Konsistenz-Modell

- 01/2025 - heute

Local-Stochastic-Volatility-Modell mit nicht-parametrischer Kalibrierung, P&L-Backtesting 2,4 % MAE auf 380 Vertragen

QuantLib-Beitraege

- 06/2024 - 12/2024

8 merged Pull Requests zu QuantLib (Heston, SABR-Kalibrierung), 2.150 Codezeilen