

Adrian Schenk

Quantitativer Analyst

✉ adrian.schenk@example.de

📍 Frankfurt am Main, Deutschland

🌐 linkedin.com/in/adrianschenk

☎ +49 69 1234 9876

🌐 adrianschenk.dev

📄 github.com/adrianschenk



PROFIL

Buy-Side Quantitativer Analyst mit 7 Jahren Erfahrung bei DWS Group und BlackRock Frankfurt. Signal-Forschung in Mid-Frequency-Equities, Faktor-Research auf Ray + Snowflake, ausgeführungs-bewusstes Backtesting. NeurIPS 2024 Workshop Paper zu Regime-Aware Portfolio Construction.

BERUFSERFAHRUNG

Quantitativer Analyst

DWS Group

Mid-Frequency-Equities-Alpha-Research

📅 04/2022 - heute 📍 Frankfurt am Main, Deutschland

- Aufbau eines Mid-Frequency-Equities-Alphas (JAX + XGBoost) mit Sharpe 2,3 über 14 Monate Out-of-Sample
- Automatisierung des Faktor-Research-Workflows auf Ray und Snowflake, Iterations-Zyklus von 6h auf 22 min verkürzt
- Veröffentlichung eines NeurIPS 2024 Workshop Papers zu Regime-Aware Portfolio Construction
- Co-Eigner einer Backtesting-Pipeline mit T-Cost-Modell, Live-Slippage gegen Sim 8 bps
- Mentoring von 3 Werkstudenten der Goethe-Uni in Python + statsmodels

Junior Quantitative Analyst

BlackRock Frankfurt

ETF-Construction und Faktor-Modelle im Index-Investments-Team

📅 07/2018 - 03/2022 📍 Frankfurt am Main, Deutschland

- Aufbau eines Optimization-Frameworks (Gurobi) für 14 Smart-Beta-ETFs mit AuM von 18 Mrd. EUR
- Implementierung eines Multi-Faktor-Modells in cvxpy, Tracking Error von 38 auf 21 bps reduziert
- Pflege von 6 Reproducible-Research-Notebooks mit Quarto + GitHub Actions

PROJEKTE

NeurIPS 2024 - Regime-Aware Portfolio

📅 09/2024 - 12/2024

Co-Autor zu HMM-basierter Regime-Erkennung in Mid-Frequency-Strategien

Ray-Faktor-Research

📅 06/2023 - 09/2023

Migration des Faktor-Backtests auf Ray + Snowflake, 16x Iterations-Speedup

AUSBILDUNG

M.Sc. Mathematik

Technische Universität München (TUM)

📅 10/2016 - 09/2018

📍 München, Deutschland

Finanzmathematik • 1,0

B.Sc. Mathematik

Universität Heidelberg

📅 10/2013 - 09/2016

📍 Heidelberg, Deutschland

Mathematik • GPA: 1,2

FÄHIGKEITEN

Python (JAX, NumPy, Pandas)

XGBoost & LightGBM

Gurobi & cvxpy Ray & Dask

Snowflake & kdb+

Backtesting-Frameworks

Statsmodels & PyMC

Time Series Econometrics

ZERTIFIKATE

CFA Level III

📅 10/2025



FRM Part II (GARP)

📅 06/2024



AWS Certified Machine Learning Specialty

📅 11/2022



SPRACHEN

Deutsch



Englisch



Französisch



STÄRKEN

Risiko-Bewusstsein

Prüfe jede Signal-Strategie auf Regime-Wechsel und Drawdown-Pfade vor Live-Schaltung

Execution-Realismus

Modelliere T-Cost und Slippage mit Live-vs-Sim-Gap unter 8 bps

Wissenschaftliche Strenge

NeurIPS Workshop Paper plus aktiver Peer-Reviewer bei JFE und QF