



Antje Brunner

Senior Risk Analystin

✉ antje.brunner@example.de

📍 München, Deutschland

🌐 linkedin.com/in/antjebrunner

☎ +49 89 4455 6677



Profil

Risk Analystin mit 7 Jahren Erfahrung im Second Line of Defense bei Allianz SE und Munich Re, M.Sc. Quantitative Finance Frankfurt School, FRM und CFA Charterholder. Aufbau von VaR-, Stress-Test- und ECL-Modellen für 38 Mrd. EUR Versicherungs-Portfolio. Direkte Berichterstattung an Chief Risk Officer.

Berufserfahrung

Senior Risk Analystin Second Line

Allianz SE • München, Deutschland • 10/2021 - heute

Group Risk Management im Second Line of Defense für Marktrisiko und ALM

- Aufbau eines VaR-Modells für 38 Mrd. EUR Kapitalanlage, 99 Prozent Konfidenz-Level mit 5-Jahres-Historie
- Solvency II SCR-Re-Kalibrierung mit 220 Mio. EUR SCR-Reduktion bei gleicher Risiko-Position
- Climate-Stress-Test in Python für 4 ECB-Szenarien, 22 Treiber dokumentiert, von Aufsicht akzeptiert
- Monatliche Risk-Präsentation an Chief Risk Officer und quartalsweise an Risiko-Komitee
- Mentor für 3 Junior-Risk-Analysten, wöchentliche Modell-Reviews und Coaching

Risk Analyst Reinsurance

Munich Re • München, Deutschland • 10/2018 - 09/2021

Underwriting Risk und Reserve Risk in der Property and Casualty Practice

- Modellierung von Reserve Risk für 14 Mrd. EUR Schaden-Rückstellungen, 28 Stress-Szenarien
- Aufbau eines Pricing-Validation-Frameworks für 84 Underwriting-Cells in SAS und Python
- Monitoring von 22 Catastrophe-Bond-Exposures mit Bloomberg und internen Stress-Tools
- Präsentation der quartalsweisen Risk-Komitee-Memos für Reserve-Adjustments über 280 Mio. EUR

Ausbildung

M.Sc. Quantitative Finance

Frankfurt School of Finance & Management

Frankfurt am Main, Deutschland

10/2016 - 09/2018

Quantitative Finance • 1,2

B.Sc. Mathematik

LMU München

München, Deutschland

10/2013 - 09/2016

Mathematik & Statistik

GPA: 1,4

Fähigkeiten

Marktrisiko & VaR

Kreditrisiko & ECL

Operationelles Risiko

Python (NumPy, pandas)

SAS Risk Management

SQL & Power BI

Basel III & IV

Solvency II Reporting

Zertifikate

CFA Charterholder

• 11/2023

Projekte

Solvency II SCR-Re-Kalibrierung

- 01/2025 - 09/2025

Re-Kalibrierung des Standard-Modell-SCR für 18 Mrd. EUR Kapitalanlage, SCR um 220 Mio. EUR reduziert

Stress-Test ECB Climate Risk

- 06/2024 - 12/2024

Climate-Stress-Test Pipeline in Python für 4 Szenarien, von Aufsicht ohne Major-Findings akzeptiert

Stärken

Modell-Validierung

Validiere Risiko-Modelle nach SR 11-7 und EBA-Leitlinien, dokumentiere Backtest-Ergebnisse mit 3-Jahres-Historie

Aufsichts-Kommunikation

Halte Memos für BaFin und EZB direkt verteidigungsfähig, 4 Aufsichts-Prüfungen ohne Major-Findings durchlaufen

Cross-Risk-Sicht

Verstehe Markt-, Kredit- und operationelles Risiko ganzheitlich, baue integrierte Risiko-Bridges für 12 Risiko-Treiber

FRM – Financial Risk Manager (GARP)

- 06/2022

Solvency II Practitioner

- 03/2021

Sprachen

Deutsch • Muttersprache

Englisch • C2

Französisch • B2