



## **(SENIOR) RISK MANAGER IM BEREICH PORTFOLIO MANAGEMENT (m/w)**

### **DAS UNTERNEHMEN**

Pinechip Capital ist ein unabhängiger Investment Manager mit Sitz in Hamburg. Bei unseren Anlageentscheidungen folgen wir konsequent einem Multi-Strategie-Investmentansatz. Nach unserer Überzeugung ist es so möglich, stabile Renditen zu erzielen – nicht korreliert mit traditionellen Assets und unabhängig von Kapitalmarktschwankungen. Wir entwickeln diversifizierte Anlageportfolien, indem wir auf den globalen Finanzmärkten attraktive Risikoprämien effizient abschöpfen.

Organisatorisch gliedert sich Pinechip Capital in die beiden Geschäftsbereiche Portfolio Management und Investment Operations; mit rund einem Dutzend hochqualifizierter Mitarbeiter. Entwicklung, Umsetzung und Management der Strategien ist Aufgabe vom Portfolio Management. Die dafür erforderliche Infrastruktur- und Prozesslandschaft stellt Investment Operations bereit. Investment Operations ist auch verantwortlich für die Erfüllung der regulatorischen sowie der Compliance- Anforderungen. Beide Bereiche arbeiten sehr eng zusammen.

In einem dynamischen Umfeld mit anspruchsvollen Aufgabenstellungen legt Pinechip Capital großen Wert auf eine kontinuierliche Unternehmensentwicklung. Die Grundlagen dafür sind: eine klar definierte Unternehmensstrategie, eine starke Unternehmenskultur sowie exzellente Prozesse und die richtige Infrastruktur. Wir sind stets bestrebt, talentierte Mitarbeiter für unser Haus zu gewinnen, zu fördern und weiterzuentwickeln. Zugleich investieren wir laufend in die Optimierung und Skalierbarkeit unserer Hard- und Softwaresysteme.

Die Pinechip Capital GmbH hat eine Erlaubnis zum Geschäftsbetrieb nach dem Kreditwesengesetz (KWG) und unterliegt der Aufsicht durch die Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin).

### **AUFGABEN- UND VERANTWORTUNGSBEREICH**

Unter der Leitung des Chief Investment Officers (CIO) arbeitet der Risiko Manager im Bereich Portfolio Management. Das Portfolio-Management-Team besteht aus den Funktionen Investment & Strategie Research, Portfolio Konstruktion, Risiko Analyse und Trade Execution. Die Risikophilosophie des Unternehmens ist die Kombination aus quantitativen Betrachtungsweisen mit exzellentem geschäftlichen Urteilsvermögen und Erfahrung sowie das Erkennen der Grenzen der Risikoquantifizierung in einem diversifizierten Risikoprämienportfolio, welches eigene und extern gemanagte Strategien einbezieht. Pinechip Capital investiert stark in Infrastruktur und Ressourcen, um das effiziente Management von Risikobudgets zu gewährleisten.

Die wichtigste Aufgabe des Risikomanagers ist es, den Märkten nicht zu erlauben, das Risiko des Portfolios zu diktieren. Insbesondere ist der Risikomanager verantwortlich für die Analyse und die Überwachung des Investment Portfolios, auf globaler und auf individueller Trade-Basis. Weiterhin unterstützt der Risikomanager die Optimierung des Portfoliokonstruktionsprozesses. Durch die Bereitstellung geeigneter Methoden, Analyse-Werkzeuge und durch enge Zusammenarbeit mit den Portfolio Managern trägt der Risikomanager zur effizienten Portfoliokonstruktion und dem



Management von Risikobudgets bei. Diese Funktion ist in allen Stadien des Investmentprozesses involviert und beinhaltet auch Themenbereiche wie die Investment Due Diligence von externen Fondsmanagern (mit Risikofokus). Aufgrund der Heterogenität der eingesetzten Strategien und ihrer Risikoprofile sowie der Allokation des nominalen Investmentvolumens nach Risikobudgets, kommt der Stelle des Risikomanagers eine zentrale Bedeutung zu. Entsprechend hoch sind die Anforderungen an die fachliche und methodische Kompetenz der Person.

Im Rahmen des allgemein beschriebenen Aufgaben- und Verantwortungsbereiches hat der Risikomanager folgende Einzelaufgaben und Verantwortlichkeiten:

- Portfolioebene
  - Gewährleistung eines umfassenden Verständnis/Schaffung von Transparenz hinsichtlich aller Portfoliorisiken und Risikoparameter
  - Beobachtung, Analyse und Evaluierung des Gesamtrisikos für den CIO und die Portfoliomanager
  - Mitwirkung bei der Modellierung und Umsetzung von Strategien im Hinblick auf Risikoparameter und Portfoliorisiken
  - Unterstützung bei der Portfoliokonstruktion unter besonderer Berücksichtigung der Risikoparameter
  - Laufende Evaluierung der Portfolioparameter im Hinblick auf eine Veränderung des definierten Rendite/ Risiko-Profiles und des damit einhergehenden Verlustrisikos
  - Monitoring von externen Managern mit Blick auf eine Änderung des Risiko- und Performanceprofils
  - Entwicklung und Design von Risikoanalysen für einzelne Strategien
  - Optimierung des Rendite/Risiko-Profiles des Portfolios und einzelner Investmentstrategien in Zusammenarbeit mit den Portfoliomanagern
  - Unterstützende Teilnahme bei Investment Due Diligence Prozessen von externen Fondsmanagern
  - Unterstützung beim Aufsetzen und Implementieren von Hedge Strategien
- Methoden und Prozesse
  - Aufsetzen und Weiterentwicklung des quantitativen risikoanalytischen Rahmenwerks (Risikomessmethoden, Risikomessung, Bewertung, Sensitivitäten, Szenario- Analysen sowie Risikobudgetauslastung) in Zusammenarbeit mit dem Risikomanagement (Bestandteil des Investment Operations Team)
  - Sicherstellung der Anwendung jeweils geeigneter Methodiken und Verfahren durch die Portfoliomanager
  - Gewährleistung der Einhaltung von Vorgaben und Richtlinien sowie vereinbarter Standards
  - Firmenübergreifende Mitwirkung und Begleitung von Projekten im Zusammenhang mit dem Aufgabengebiet
- Dokumentation und interne Organisation
  - Mitarbeit bei der Konzeption und Erstellung/Pflege eines Risikohandbuchs
  - Dokumentation von Parametrisierungen und Risikoszenarien
  - Mitwirkung und Begleitung des Product-Risk-Prozesses
  - Sicherstellung aktueller Dokumentationsstände
  - Abstimmung/ Koordination mit der Funktion Risikomanagement



## **ANFORDERUNGSPROFIL**

### **Ausbildung und Berufserfahrung**

- Abgeschlossenes Hochschulstudium (mit Schwerpunkt Finanzen, Statistik, Ökonometrie, Mathematik, Quantitative Finance)
- Höherer akademischer Abschluss (z.B. PhD, MBA), sowie berufsqualifizierende Aus- und Weiterbildungen (z.B. CFA, FRM) sind ein Vorteil
- Mehrere Jahre relevante Berufserfahrung im Bereich Risikoanalyse von Hedge Fund Strategien und derivativen Produkten (vorzugsweise auf der Buy- Side)
- Ausgeprägter Fach- und Erfahrungshintergrund im quantitativen Bereich, insbesondere in statistischer Analyse von Investmentrisiken
- Fähigkeit zur Handhabung großer Datensätze und Erfahrung in der Programmierung statistisch/ ökonomischer Software (z.B. MatLab, R, o.ä.)
- Vorhandene Kenntnisse im Umgang mit Portfolio Managementsystemen (z.B. FusionInvest oder Sungard Hedge360) von Vorteil
- Erfahrung im Umgang mit Finanzinformationssystemen (z.B. Bloomberg)
- Erfahrung mit unterschiedlichen Assetklassen (Cross- Asset- Fokus) von Vorteil

### **Persönlichkeit und Arbeitsstil**

- Analytisches Denkvermögen
- Selbstständiges und eigenverantwortliches Arbeiten mit hohen Qualitätsansprüchen und dem Blick fürs Detail
- Hohe Eigenmotivation sowie die Bereitschaft Dinge permanent zu hinterfragen und sich zu verbessern
- Fähigkeit komplexe Sachverhalte zu verstehen und in klarer und präziser Weise zu erklären
- Sicheres Auftreten und Durchsetzungsvermögen gegenüber Dritten durch fachliche Kompetenz und inhaltliche Überzeugungskraft
- Schnelle Auffassungsgabe und sicheres Arbeiten unter Zeitdruck

## **DAS ANGEBOT**

- Intellektuell anspruchsvolle und abwechslungsreiche Aufgaben
- Schnelle Verantwortungsübernahme
- Individuelle fachliche und persönliche Entwicklung

Über den eigenen Aufgabenbereich hinaus bietet die Position einen breiten Einblick in das gesamte Spektrum des Asset Managements bei einem professionellen Investment Manager mit einem progressiven Investmentansatz und einer modernen technischen Infrastruktur.

Das Unternehmen zeichnet seine flachen Hierarchien, die Aufgeschlossenheit für neue Ideen und ein äußerst ansprechendes Arbeitsumfeld in bester Lage aus.

Hervorragende Qualifikationen, Fähigkeiten und Erfahrungen finden im Gehaltspaket besondere Berücksichtigung.



## **KONTAKT**

Bitte senden Sie Ihre vollständige Bewerbung (Lebenslauf, Zeugnisse, Referenzen) an [hr@pinechip.capital](mailto:hr@pinechip.capital)

Für Fragen steht Ihnen Frau Susan Nähring gerne telefonisch, unter der Rufnummer +49 (40) 607 730 6-0 zur Verfügung