

13. Juni 2024

# FACHTAG Performance- messung und GIPS® Frankfurt am Main

Der Fachtag „Performancemessung und GIPS“ ist der jährliche Branchentreff im deutschsprachigen Raum für Experten und Interessierte, die sich bei Finanzdienstleistern oder als institutionelle bzw. private Anleger mit der Messung und Analyse von Investmentperformance beschäftigen. Die Präsenzveranstaltung wird vom German Asset Management Standards Committee (GAMSC) durchgeführt, einem Zusammenschluss von BVI, CFA Society Germany und DVFA.

Themenschwerpunkt in diesem Jahr ist die digitale Entwicklung. Vorträge, Podiumsdiskussionen und Workshops werden Aktuelles und Praxisberichte zu digitalen Assets und zum Einsatz künstlicher Intelligenz im Fondsmanagement beleuchten. Ergänzt um Vorträge zu weiteren Themen der Performancemessung wartet wieder ein abwechslungsreiches Programm auf Sie, unterstützt durch Aussteller und mit vielen Gelegenheiten zum Netzwerken.

**GAMSC** GERMAN ASSET MANAGEMENT  
STANDARDS COMMITTEE

**BVI**

**CFA Society  
Germany**

**DVFA**

Medienpartner

**Absolut**  
research

portfolio  
institutionell

**private banking**  
magazin

# Performancemessung und GIPS® 13. Juni 2024

## AGENDA

Uhrzeit	Titel
9:00 Uhr	<b>Begrüßung GAMSC</b> Rudolf Siebel   BVI
9:15 Uhr	<b>GIPS-Neuigkeiten</b> Christoph Trittman   DPG Deutsche Performancemessungs-Gesellschaft für Wertpapierportfolios mbH
9:50 Uhr	<b>ESG und Performanceattribution</b> Ralf Krause   Union Asset Management Holding AG
10:20 Uhr	<b>Kaffeepause</b>
11:00 Uhr	<b>Digitale Assets im Fokus – Typen, Preisfindung, Handel, Chancen und Herausforderungen</b> Sebastian Hailer   Tradias GmbH
11:35 Uhr	<b>Tokenisierung von Fondsanteilen: Erfahrungsbericht und allgemeiner Marktausblick</b> Shahrok Shedari   Bankhaus Metzler
12:10 Uhr	<b>Podiumsdiskussion: Digitale Assets im Performancecontrolling</b> Sebastian Hailer   Tradias GmbH Hendrik König   Bankhaus Metzler Dr. Tim Kreuzmann   BVI Moderation: Volker Braunberger   INTAS.tech GmbH
13:00 Uhr	<b>Mittagessen</b>
14:00 Uhr	<b>Stock-Picking auf Basis künstlicher Intelligenz – Erfahrungsbericht</b> Dr. Eric Endress   Acatis Investment Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH
14:25 Uhr	<b>Multi-Asset-Strategie auf Basis künstlicher Intelligenz – Erfahrungsbericht</b> Michael Günther   Tungsten Capital Management GmbH
14:45 Uhr	<b>Podiumsdiskussion: ChatGPT als Investmentmanager? Welches Potenzial hat künstliche Intelligenz für Investmentfonds?</b> Nico Baum   Joh. Berenberg, Gossler & Co. KG Dr. Eric Endress   Acatis Investment Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH Michael Günther   Tungsten Capital Management GmbH Moderation: Dr. Andreas Schmidt-von Rhein   VM Vermögens-Management GmbH
15:25 Uhr	<b>Kaffeepause</b>

Uhrzeit	Titel
<b>16:00 Uhr</b>	<b>3 Workshops* (finden zeitgleich statt)</b>
	<b>Workshop 1: Einführung in die GIPS</b> Martin Schliemann   FFA Frankfurt Finance Audit
	<b>Workshop 2: Case Study Union Investment – Einsatz von künstlicher Intelligenz im Data Quality Management</b> Benedikt Höck   KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft Kerstin Manthey   Union Service-Gesellschaft mbH Dr. Felix Schmidt   Union Service-Gesellschaft mbH
	<b>Workshop 3: Investmentfonds auf die Blockchain – Wie geht das genau?</b> Volker Braunberger   INTAS.tech GmbH
<b>17:15 Uhr</b>	<b>Get-together</b>
	<b>Moderation des Fachtages:</b> Martin Schliemann   FFA Frankfurt Finance Audit Dr. Andreas Schmidt-von Rhein   VM Vermögens-Management GmbH

\* Die Teilnehmerzahl der Workshops ist begrenzt. Die Teilnehmer werden nach dem Zeitpunkt der Anmeldung berücksichtigt.

### **Nico Baum**

leads the Innovation & Data team and is Head of Business Management & Development in Asset Management at Berenberg. He was previously COO & Portfolio Manager in an Asset Management FinTech focused on Big Data Analytics and before this, worked in Investment Banking at a leading German bank in Frankfurt and Hong Kong.

### **Volker Braunberger**

hat nach seiner Ausbildung zum Bankkaufmann und dem sich anschließenden Studium der Betriebswirtschaftslehre (Dipl.-Kfm.) seine Karriere bei Coopers & Lybrand (später PricewaterhouseCoopers Unternehmensberatung) begonnen. Nach erfolgreicher 5-jähriger Tätigkeit in der Beratung von Finanzinstituten übernahm Herr Braunberger die Rolle des geschäftsführenden Partners bei der itechx GmbH.

In seiner mittlerweile über 25-jährigen Karriere hat er für nationale und internationale Banken und Asset Manager zahlreiche Projekte erfolgreich umgesetzt. Sein fachlicher Schwerpunkt lag und liegt auf dem „Wertpapier-Geschäft“ und dem „Assetmanagement“.

Sein tiefgreifendes fachliches und regulatorische Wissen hat Herr Braunberger in den letzten 3-4 Jahren genutzt, um Anwendungsgebiete neuer Technologien für Banken & Assetmanager zu untersuchen und hat seinen Schwerpunkt dabei mehr und mehr auf blockchain- (DLT-) basierte Technologien gelegt.

Als Konsequenz daraus hat er diesen Schwerpunkt auch beruflich manifestiert und zum einen die Gründung der INTAS.tech GmbH vorangetrieben, die als Tochter der Frankfurt School of Finance & Management und der Plutoneo Consulting GmbH in Q2-2021 ihren Geschäftsbetrieb aufgenommen hat, und bei der Herr Braunberger die Rolle des CEO wahrnimmt. Zum anderen hat er Anfang 2021 das FinTech Start Up „Funds On Chain GmbH“ gegründet, das eine Plattform zur DLT-basierten Abwicklung von Investmentfondsanteilen entwickelt. Dort hat Herr Braunberger die Rolle des Product Owner's inne und verbindet damit seine fachliche Expertise in idealer Form mit dem Aufbau einer marktorientierten, disruptiven Technologie-Plattform für Investmentfonds.

### **Dr. Eric Endress**

studierte Theoretische Physik an der Johannes Gutenberg-Universität in Mainz und schloss seine Promotion an der Universidad Autónoma de Madrid ab.

Bevor er 2017 zu ACATIS kam, war er Forscher an der Pontificia Universidad Católica del Perú, wo er an Forschungsprojekten am CERN und Fermilab teilnahm. Bei ACATIS ist er für den Bereich Künstliche Intelligenz zuständig.

### **Michael Günther**

hat mehr als 20 Jahre in der CTA-Branche gearbeitet und verfügt über umfangreiche Erfahrungen im Portfoliomanagement und in der Entwicklung von KI-basierten Multi-Asset-Handelsstrategien.

Seit dem Jahr 2000 beschäftigt er sich mit der Anwendung von künstlicher Intelligenz und maschinellem Lernen an den Finanzmärkten und ist Co-Manager des ältesten KI-basierten UCITS-Fonds.

Sein Schwerpunkt ist neben dem Portfolio Management die Programmierung und Weiterentwicklung der proprietären, KI-basierten Portfolio- und Risk-Management Software QuantMatrix.

Seit 2002 ist er Mitglied des Vorstands der TRYCON G.C.M. AG und seit 2013 Portfoliomanager bei Tungsten Capital, einer Vermögensverwaltungsgesellschaft mit Sitz in Frankfurt am Main, Deutschland.

### **Sebastian Hailer**

Mit über sechs Jahren Erfahrung im Finanzsektor und einem Fokus auf digitalen Innovationen und Blockchain-Technologie leitet Sebastian Hailer seit 2022 den Geschäftsbereich innerhalb der Tradias und des Bankhaus Scheich. Zuvor hat er den digitalen Wandel innerhalb einer Privatbank in München mitverantwortet und ein DLT-orientiertes Banking-as-a-Service Angebot etabliert. Seine Erfahrungen hat er als Projekt- und Technologieleiter sowie in der Strategieberatung gesammelt.

### **Benedikt Höck**

ist Partner im Bereich Strategie- und Managementberatung der KPMG. Er verantwortet das Thema (Generative) KI für KPMG Deutschland. In diesem Zuge berät er Kunden bei der erfolgreichen Implementierung von KI und treibt zudem die interne Nutzung von KI bei KPMG voran.

### **Hendrik König**

ist seit 2008 bei Metzler tätig und seit 2022 für die neu gegründete bereichsübergreifende Stabsstelle Digital Assets Office zuständig, deren Leitung er 2023 übernommen hat. Das Digital Asset Office befasst sich mit der DLT-Technologie und deren Anwendungsmöglichkeiten. Zuvor war er verantwortlich für die Aktienstrategie und das Quant-Team im Geschäftsfeld Capital Markets Bereich. Herr König hat einen B.A.-Abschluss in Wirtschaftswissenschaften der Universität Paderborn und absolvierte ein Masterstudium mit den Schwerpunkten Finanzen und Wirtschaftswissenschaften an der University of San Francisco in den USA.

### **Ralf Krause**

ist seit 2022 Leiter der Abteilung Investmentanalyse im Bereich Investmentanalyse und -controlling und verantwortet hier das Performancecontrolling der Produkte der Union Investment-Gruppe. Ferner leitet er seit 2008 die Gruppe Integrationsmanagement, die für das zentrale Fondsdatawarehouse, den neue Instrumente Prozess sowie verschiedene Querschnittsthemen zuständig ist.

Vor Beginn seiner Tätigkeit bei Union Investment als Business-Analyst im Jahr 2001 war Herr Krause bei Dresdner Kleinwort tätig.

Nach seiner Schulausbildung studierte er Wirtschaftswissenschaften an der Justus-Liebig-Universität Gießen mit den Schwerpunkten Wirtschaftsinformatik, Statistik und Controlling.

Neben seiner Tätigkeit bei Union Investment war Herr Krause über viele Jahre als Dozent an der Frankfurt School of Finance and Management und als Prüfer für die IHK-Frankfurt tätig.

### Dr. Tim Kreutzmann

ist Abteilungsdirektor Recht beim deutschen Fondsverband BVI. Er ist zuständig für offene Wertpapierfonds, anlegerspezifische Regulierung von Kreditinstituten, Versicherungen und Pensionskassen sowie Handels- und Marktregulierung. Zudem koordiniert er die Verbandsaktivitäten betreffend digitale Vermögensgegenstände, Kryptowerte und DLT-Marktinfrastruktur. Herr Kreutzmann hat im Handels- und Finanzrecht promoviert und einen Masterabschluss im internationalen Handelsrecht. Vor seinem Eintritt beim BVI war Herr Kreutzmann als Rechtsanwalt und Fachanwalt für Steuerrecht mit den Schwerpunkten Asset Management, Alternative Investments, Steuer- und Regulierungsberatung tätig.

### Kerstin Manthey

ist Gruppenleiterin im Datenmanagement der Union Investment. Ihre Gruppe Kursversorgung & Marktgleichheit ist zentraler Ansprechpartner und Dienstleister innerhalb der Union Investment Gruppe für die Bewertung von Finanzinstrumenten. Von Aktien bis hin zu komplexen Derivaten deckt ihre Gruppe das komplette Spektrum über Kurse von Datenanbietern und eigene Bewertungsmodelle für den gesamten Investmentprozess ab.

### Martin Schliemann

arbeitet seit fast 30 Jahren als Wirtschaftsprüfer, GIPS-Verifizierer und Berater für die Assetmanagement-Industrie. Nach langjährigen Stationen bei KPMG und als Partner der Ernst & Young AG ist er seit 2009 Geschäftsführer der Frankfurt Finance Audit. Herr Schliemann war als Mitglied verschiedener internationaler Gremien, u.a. des Verifier Subcommittee sowie als Vorsitzender des RIPS EMEA in der GIPS Bewegung tätig. Im November 2015 hat er routinemäßig seinen Sitz im Global Executive Committee der GIPS Organisation abgegeben.

### Dr. Felix Schmidt

ist als Senior Data Scientist bei Union Investment tätig. Zusammen mit seinen Kolleginnen und Kollegen aus der Abteilung Zukunftstechnologien und Digitalisierung setzt er Anwendungsfälle aus den Bereichen maschinelles Lernen und KI in den verschiedenen Unternehmensbereichen um. Sein Fokus liegt dabei auf der Erstellung von Prognose- und Klassifikationsmodellen sowie der Anwendung von Modellen aus dem Bereich der natürlichen Sprachverarbeitung.

### Dr. Andreas Schmidt-von Rhein

ist seit März 2024 bei der VM Vermögens-Management GmbH (Düsseldorf) als Geschäftsführer tätig und verantwortet die Themenbereiche Operations, IT und Marktfolge. Zuvor war er fast zehn Jahre in leitenden Funktionen bei der FERI-Gruppe (Bad Homburg) beschäftigt. Ab 2016 baute er als Vorstand die FEREAL AG auf, die deutsche AIF-KVG für Sachwertfonds der FERI Gruppe mit Schwerpunkt Private Equity und Immobilien und leitete den Marktfolgebereich. 2020 wurde er als Geschäftsführer der FERI Trust GmbH berufen und leitete dort die Geschäftsbereiche Operations & Investment Services. Zudem war Schmidt-von Rhein als Co-Leiter für das FERI SDG Office, in dem die Nachhaltigkeitsaktivitäten der FERI-Gruppe gebündelt werden, als Projektleiter für den Bereich Digital Assets, als Leiter der Evidenzzentrale zum Monitoring der

Investmentregulierung und als Leiter des Product Ideas Board (Produktentwicklung) verantwortlich.

Vor seinem Einstieg bei FERI war Dr. Schmidt-von Rhein bei Sal. Oppenheim seit 1996 in verschiedenen Führungspositionen in der institutionellen und privaten Vermögensverwaltung in Köln und Luxemburg tätig, wie z.B. die Bereiche Performancecontrolling, Risikocontrolling und Risikomanagement.

Herr Dr. Schmidt-von Rhein studierte Wirtschaftsinformatik an der Universität Bamberg und promovierte 1992 am Lehrstuhl für Finanzwirtschaft und Banken der Universität Freiburg.

### Shahrok Shedari

arbeitet seit 2015 bei Metzler. Seit 2022 ist er stellvertretender Leiter der neu gegründeten bereichsübergreifenden Stabstelle Digital Assets Office, die für die DLT-Technologie und deren Anwendungsmöglichkeiten zuständig ist. Zuvor baute Herr Shedari die Innovationseinheit DigitalManufaktur bei Metzler auf, die sich mit disruptiven Themen und ihrer strategischen Relevanz befasst. Von 2016 bis 2020 leitete er das Service Management in der Metzler FundServices GmbH nachdem er davor ein Jahr im Bereichscontrolling im Metzler Asset Management gearbeitet hatte. Herr Shedari studierte an der Goethe-Universität Frankfurt am Main und erwarb 2015 den Master of Science in Finanzen & Informatik sowie 2013 den Bachelor of Science in Wirtschaftswissenschaften. Zwischen 2008 und 2010 absolvierte er eine Ausbildung zum Kaufmann für Marketingkommunikation.

### Christoph Trittmann

ist seit 2007 Mitarbeiter im Client Service der DPG Deutsche Performancemessungs-Gesellschaft.

Nach seiner Berufsausbildung bei der Dresdner Bank AG sowie des Studiums der Betriebswirtschaftslehre und einer 18-monatigen Beschäftigung als wissenschaftlicher Mitarbeiter am Lehrstuhl für Volkswirtschaftslehre, insbesondere Geld und Konjunktur an der Universität Siegen, nahm er seine Tätigkeit bei der DPG auf. Schwerpunkt seiner Tätigkeit ist die Betreuung von Kapitalanlagegesellschaften und institutionellen Kunden. Aktuell nutzen drei der von ihm betreuten Kunden das GIPS-Reporting der DPG.

Herr Trittmann hat an Projekten zur Initiierung des Reportings und zum Aufbau der jeweiligen GIPS-Einheit mitgearbeitet und ist regelmäßig in die Erstellung der Reports zur Zertifizierung nach GIPS eingebunden. Herr Trittmann ist seit 2017 Mitglied des GAMSC.

## Anmeldung und Gebühren

Die Teilnahmegebühr (pro Person) beträgt:

Für BVI- Mitglieder, CFA Society Germany- und DVFA-Mitglieder EUR 300,00 (zzgl. MwSt.), für Nicht-Mitglieder EUR 600,00 (zzgl. MwSt.).

In der Teilnahmegebühr sind Tagungsunterlagen, Mittagessen sowie Pausen- und Erfrischungsgetränke enthalten.

Für Ihre Anmeldung nutzen Sie bitte den Link:  
<https://events.bvi.de/Seminare/event.php?vnr=747-110>

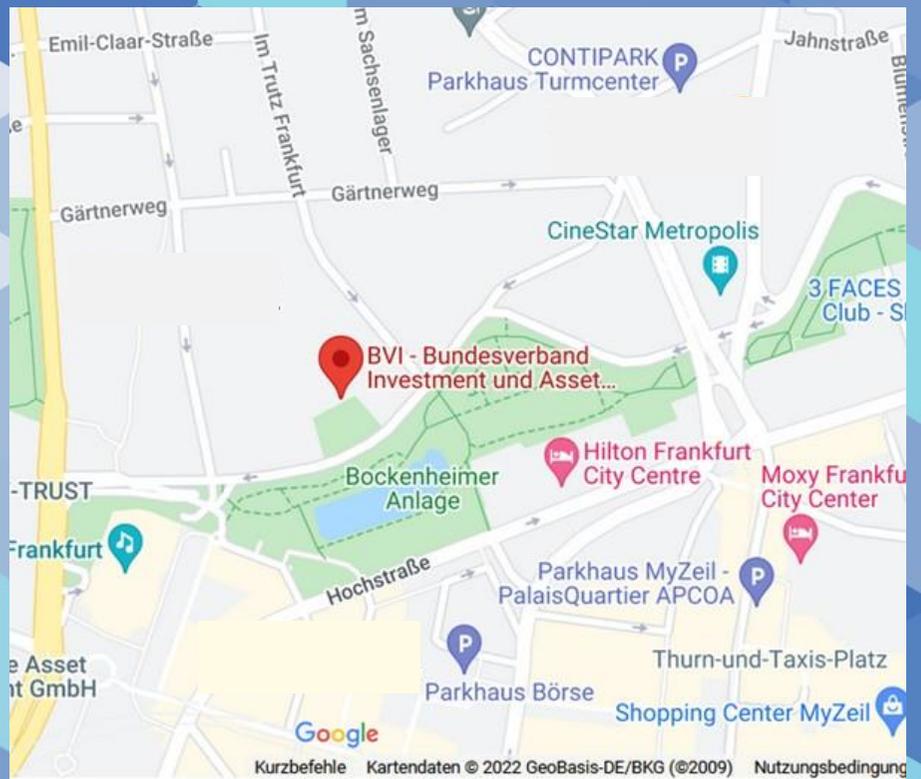
## Ansprechpartnerin

Für Rückfragen steht Ihnen Simone Dungs unter der Telefonnummer 069 154090-293 bzw. per E-Mail [veranstaltungen@bvi.de](mailto:veranstaltungen@bvi.de) gerne zur Verfügung.

## Veranstaltungsort

BVI

Bockenheimer Anlage 15  
60322 Frankfurt am Main



## GAMSC GERMAN ASSET MANAGEMENT STANDARDS COMMITTEE



Medienpartner

**Absolut**  
research

portfolio  
institutionell

private banking  
magazin