

## PROGRAMM

Uhrzeit	Thema
09:00	<b>Registrierung der Teilnehmer</b>
09:30	<b>Begrüßung</b> Martin Schliemann   FFA Frankfurt Finance Audit
09:45	<b>Vortrag: Herausforderungen für das Asset Management im 21. Jahrhundert</b> Carsten Wittrock   zeb
10:30	<b>Kaffeepause</b>
10:45	<b>Podiumsdiskussion: GIPS 2020 – Auswirkungen für Investoren, Asset Manager und Consultants</b> Carsten Wittrock   zeb Gabriele Boeger   AGI Hans Groetsch   StatPro Moderation: Andreas Schmidt-von Rhein   FERREAL
12:00	<b>Wrap-up: GIPS 2020 as a global industry standard</b> Iain McAra   CFA Institute
12:15	<b>Mittagspause</b>
13:00	<b>Vortrag: Neue Regeln für nachhaltiges Investieren</b> Marcus Mecklenburg   BVI
13:45	<b>Vortrag: Nachhaltigkeitsrisiken identifizieren, messen, und bewerten</b> Karoline Hallmeyer   KPMG
14:15	<b>Kaffeepause</b>
14:30	<b>Workshops (finden zeitgleich statt)</b>
	<b>Workshop 1:</b> <b>Einsteigerworkshop für Investoren und Asset Manager</b> Martin Schliemann   FFA Frankfurt Finance Audit
	<b>Workshop 2:</b> <b>GIPS 2020: Spezialistenworkshop</b> Norbert Tolksdorf   Single Family Office
	<b>Workshop 3:</b> <b>Herausforderungen der Performancemessung im Hinblick auf ESG</b> Ralf Hudert   DWS
16:00	<b>Get-together</b>

## REFERENTEN

### Martin Schliemann

arbeitet seit fast 25 Jahren als Wirtschaftsprüfer, GIPS-Verifizierer und Berater für die Asset Management 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. Er ist Vorsitzender des deutschen Investment Performance Standards Committee (IPS).

### Dr. Carsten Wittrock

ist Partner der auf Finanzdienstleistungsunternehmen spezialisierten Unternehmensberatung zeb rolfes.schierenbeck.associates und ist dort u.a. für das Competence Team Private Banking, Asset & Wealth Management verantwortlich. Er berät Kapitalverwaltungsgesellschaften und Investoren insbes. in Fragen des Vertriebs sowie der Ausgestaltung des gesamten Investmentprozesses. Aktuell beschäftigt sich Dr. Wittrock vor allem mit Vertriebsansätzen von Anbietern alternativer Investments im institutionellen Umfeld, mit der Realisierung von Effizienzpotenzialen im Asset Management sowie mit Fragestellungen rund um das Thema ESG. Vor seinem Einstieg in die Beratung im Jahre 1995 promovierte Dr. Wittrock zum Thema „Messung und Analyse der Performance von Wertpapierportfolios“. Der gelernte Bankkaufmann veröffentlichte zahlreiche Beiträge zum Bereich Asset Management und Financial Products und ist seit Jahren als Referent im Rahmen des CIIA-Lehrgangs der DVFA tätig. Herr Wittrock leitete in den Anfängen der Performance Standards die damalige DVFA-Kommission, welche die DVFA-PPS erarbeitete und begleitete auch deren Transition in die GIPS. Daneben führte Herr Wittrock die GIPS bei namhaften Asset Managern ein.

### Gabriele Boeger, CFA

ist Senior Investment Analystin bei Allianz Global Investors, einem aktiven Investmentmanager für institutionelle und private Kunden, der zur Allianz Gruppe gehört. In dieser Funktion überwacht sie Multi Asset und Fixed Income Mandate der Investmentzentren in Europa, USA und Asien. Sie stellt sicher, dass alle Performance- und Risikoquellen der Portfolien vom jeweiligen Portfolio Manager und den zuständigen globalen und regionalen CIOs vollumfänglich verstanden und angemessen gemanagt werden. Gabriele Boeger verfügt über mehr als 20 Jahre Erfahrung in der Portfolioanalyse, Performance- und Risikozerlegung und GIPS. Im Rahmen ihrer langjährigen Tätigkeit als Produkt Analystin war sie seit 2005 für das Qualitätsmanagement und die Performanceanalyse der

europäischen Publikumsfondspalette von Allianz Global Investors verantwortlich und betreute alle produktbezogenen GIPS Themen. Davor hatte sie mehrere leitende Positionen in dieser Fondsgesellschaft inne, u.a. leitete sie die Teams Performance Measurement und Fund Controlling und baute das Team Fund Research auf. Gabriele Boeger ist Mitglied des GAMSC-Boards und vertritt Allianz Global Investors im BVI-Arbeitskreis „Performance“.

### **Hans Groetsch, CEFA, CIPM**

betreut als Product Manager bei StatPro seit 2000 die Entwicklung der Software StatPro Composites und der damit verbundenen Reportingwerkzeuge. Zum Aufgabenbereich gehören dabei neben der Spezifizierung neuer Funktionen und der kontinuierlichen Verbesserung des Produktes auch Support und Schulungen für Anwender sowie die Begleitung von Kunden bei der Implementierung der GIPS durch den gesamten Prozess von der Datenerfassung über Compositedefinitionen bis hin zur Berichterstellung und Vorbereitung der Verifizierung. Betreute Kunden umfassen dabei Asset Manager, Asset Owner, Privatbanken und Dienstleister in Europa, Asien, Nordamerika und Südafrika. Passive und aktive Teilnahme an nationalen und internationalen Konferenzen und Veranstaltungen zum Thema GIPS sind wichtige Bausteine im Tätigkeitsfeld. Vor seinem Wechsel zu StatPro war Hans Groetsch über mehrere Jahre, zuletzt als Head of Performance Measurement bei Credit Suisse Asset Management in Deutschland unter anderem für die Einführung und Umsetzung der Vorgängerstandards von GIPS (AIMR-PPS, DVFA-PPS) im Rahmen eines globalen Projektes verantwortlich.

### **Dr. Andreas Schmidt-von Rhein**

ist seit 2014 bei der FERI-Gruppe tätig und seit 2016 als Vorstand der FEREAL AG (AIF-KVG für Sachwertfonds) für Risk, Structuring & Compliance, Finanzen/Personal und FERI Services verantwortlich. Weiterhin leitet er das Investment Risk Management und das Investment Controlling für die gesamte FERI-Gruppe. Vorher verantwortete er bei Sal. Oppenheim seit 1996 in verschiedenen Funktionen u.a. die Bereiche Performancecontrolling, Risikocontrolling und das aufsichtsrechtliche Risikomanagement für die institutionelle Vermögensverwaltung, zeitweise auch als Geschäftsführer für die Luxemburger Fondstochter und für das Private Banking von Sal. Oppenheim. Er war verantwortlich für die Einführung von GIPS im Oppenheim Asset Management und ist seit vielen Jahren Mitglied des deutschen Investment Performance Standards Committee (IPS) sowie stellvertretender Vorsitzender des BVI-Fachausschusses „Risikomanagement und Performance“.

### **Iain McAra**

is a director of investment performance standards for the Europe, Middle East and Africa (EMEA) region at CFA Institute. He is responsible for leading CFA Institute activities in the EMEA region related to the GIPS standards,

including managing and developing relationships with country sponsors and volunteers. McAra serves as a spokesperson, conducts outreach to industry stakeholders, and provides oversight on regional and technical committees and working groups.

### **Marcus Mecklenburg**

leitet seit 2013 beim deutschen Fondsverband BVI die Rechtsabteilung. Diese befasst sich mit zentralen EU-Dossiers wie die AIFM- und die OGAW-Richtlinie, MiFID II oder PRIIPs, aber auch mit der nationalen Fondsgesetzgebung und sämtlichen Fragen im Zusammenhang mit dem KAGB und verwandten Rechtsbereichen in Deutschland. Mecklenburg ist Rechtsanwalt und gelernter Bankkaufmann.

### **Karoline Hallmeyer**

ist Assistant Manager und Sustainable Finance Spezialist bei KPMG im Management Consulting Asset Management. In dieser Funktion arbeitet sie an verschiedenen Fragen zum Thema Sustainable Finance mit besonderem Fokus auf Regulatorik, nachhaltigen Geschäftsstrategien, und dem Management von Nachhaltigkeitsrisiken. In den letzten fünf Jahren hat sie Impact Fonds entwickelt, CleanTech Private Equity Portfolien überwacht und bewertet, und an der Erkennung von Klimarisiken, sowie der Finanzierung von Adaptationsstrategien und -technologien gearbeitet. Sie war zum Beispiel Teil der Expertengruppe, die den Green Bonds Standard für Climate Adaptation und Resilience Bonds von Climate Bonds Initiative entwickelt hat. Gerade arbeitet Karoline mit dem Weltwirtschaftsforum an Initiativen, die den grünen Venture Capital Sektor in Europa fördern sollen, mit dem Ziel den Green New Deal zu unterstützen und die Wettbewerbsfähigkeit Europas zu stärken.

### **Dr. Norbert Tolksdorf**

leitet eine private Vermögensverwaltung (Single Family Office) und verfügt über mehr als 20 Jahre Berufserfahrung in der empirischen Kapitalmarktforschung (Risikomodellierung, Strategische Asset Allocation, Performance Analyse) sowie dem Financial Engineering/Produktentwicklung für das quantitative Portfolio Management). Als Investment Professional war er für den Konzern um das Bankhaus Sal. Oppenheim jr. & Cie. AG & Co. KGaA und die Deutsche Bank AG in verschiedenen Leitungspositionen tätig, u. a. als Leiter Portfolio Consulting (Alternative Investments) und verantwortete die Quantitative Analyse 1als Geschäftsführer der Oppenheim Research GmbH. Dem BVI steht er ehrenamtlich seit 2002 im Rahmen verschiedener Arbeitskreise (derzeit „AK Performance“) beratend zur Seite, dem GAMSC seit 2005.

### Ralf Hudert, CIPM

ist Leiter Performance Analytics & Consulting bei der DWS Beteiligungs GmbH. Seine Tätigkeitsschwerpunkte sind die Weiterentwicklung der Performance Methoden, insbesondere der Fixed Income Attribution, sowie Interpretation der Analyseergebnisse. Herr Hudert hat Diplom Wirtschaftsmathematik an der Universität Augsburg studiert. Nach 3 Jahren erster Berufserfahrung im Controlling einer renommierten deutschen Versicherung arbeitet Herr Hudert seit 23 Jahren in diversen Bereichen der Deutschen Bank. Er war 10 Jahre im Bereichscontrolling für Global Markets verantwortlich für die tägliche Performance- und Risikoberechnung der Handelsbereiche Foreign Exchange, Futures und Options sowie die Reflektion der Ergebnisse in den Financial Statements der Bank. Herr Hudert ist regelmäßiger Sprecher auf Fachkonferenzen zum Thema Performance Measurement sowie Mitglied diverser Gremien und fachspezifischer Arbeitskreise.