

# FRAGEMODUL

## ZUR BEWERBUNG UM DEN **DPN-AWARD** **AKTIENSTRATEGIE 2022** MIT BESONDEREM FOKUS AUF ESG-KRITERIEN

Mit dem Award werden bemerkenswerte und innovative Aktienstrategien ausgezeichnet, sowie deren gelungene strategische und operative Umsetzung im Gesamtportfoliokontext. Die Bewertung erfolgt unter Berücksichtigung der institutionsspezifischen Zielsetzungen, der bilanziellen Vorgaben bzw. des jeweiligen regulatorischen Regimes. Ein besonderer Fokus wird bei der Bewertung auf der schlüssigen Umsetzung von ESG-Kriterien liegen. Die Auszeichnung wird im Rahmen der festlichen Abendveranstaltung der **dpn Assets & Liabilities Convention (ALC)** am 20. September 2022 verliehen.

### **INITIATOR DER AUSZEICHNUNG**

ist die **F.A.Z. Business Media GmbH** als 100-prozentige Tochter der **Frankfurter Allgemeinen Zeitung GmbH**.

### **BEWERTUNGSINSTANZ**

ist der externe Experten-Beirat von **institutional assets** und **dpn**, der sich in Spezialisten-Komitees pro Award untergliedert. Die Besetzung der, für die einzelnen Awards zuständigen Komitees wird Ihnen bei Anmeldung Ihrer Bewerbung individuell bekanntgegeben. Den gesamten Beirat finden Sie in seiner aktuellen Zusammensetzung auf **www.dpn-online.com** vorgestellt.

### **VISIBILITÄT DER AUSZEICHNUNG**

Den ausgezeichneten Institutionen, insbesondere deren signifikantem Beitrag zur Altersvorsorge in Deutschland wird eine Sonderveröffentlichung in der **Frankfurter**

**Allgemeinen Zeitung** im Nachgang der Veranstaltung gewidmet. In der Fachpublikation **dpn – Deutsche Pensions & Investmentnachrichten** wird über die Awards, die **dpn Assets & Liabilities Convention**, die Preisträger und die Hintergründe der Auszeichnungen ausführlich berichtet.

### **VERTRAULICHKEIT IM UMGANG MIT IHREN ANGABEN**

Zu keinem Zeitpunkt und unter keinen Umständen werden Ihre Angaben oder daraus gewonnene Erkenntnisse veröffentlicht, an Dritte oder an unsere Redaktion weitergegeben oder zu Zwecken außerhalb des Bewertungsprozesses verwendet. Vier Wochen nach der Verleihung werden alle Unterlagen und Scorecards vom Veranstalter und von den Bewertungskomitees unwiederbringlich gelöscht.

Wir bitten Sie, im Falle Ihrer positiven Entscheidung zur Teilnahme

- Ihre Teilnahme bis zum **04.03.2022** anzumelden,
- das vorliegende Fragemodul bzw. das Basismodul zu bearbeiten
- und bis zum **27.05.2022** zu retournieren.

Für Ihre Anmeldung, die Einreichung Ihrer Angaben und alle Rückfragen zum Ablauf steht Ihnen als Ansprechpartnerin gerne zur Verfügung: **Julia Dingerling, Projektleitung**, [julia.dingerling@institutional-assets.com](mailto:julia.dingerling@institutional-assets.com), Telefon: (069) 75 91-32 94.

Sie können zur Bearbeitung das vorliegende Dokument verwenden, oder die Fragen in ein eigenes Dokument/Layout übernehmen. Weitere Hinweise zur Bearbeitung erhalten Sie bei Anmeldung Ihrer Bewerbung.

**Unternehmen/Institution:** \_\_\_\_\_

**Name des Verantwortlichen für den Anlagebereich:** \_\_\_\_\_

**Name des Bearbeiters/Ansprechpartners:** \_\_\_\_\_

**Postanschrift:** \_\_\_\_\_

**Telefon:** \_\_\_\_\_

**E-Mail:** \_\_\_\_\_

## STRATEGISCHE EINORDNUNG IN DEN GESAMTANLAGEN

1. Wie hoch ist der Anteil von Aktienanlagen im Verhältnis zu Ihren Gesamtanlagen. Wie hat sich dieser Anteil über die letzten Jahre entwickelt und welche zukünftige Entwicklung planen Sie?
2. Welche Anlageziele ( absolut, relativ, Diversifikation etc.) verfolgen Sie mit diesen Anlagen?
3. Welche Ergebnisse wurden tatsächlich erreicht? Stellen Sie bitte die relative Wertentwicklung im Bezug zu Benchmarks und gewünschtem Risiko dar
4. Auf welche Weise wurde/wird die jeweilige Quote für Investments innerhalb der Asset- Liability-Modellierung festgelegt? Welche Parametrisierung wird verwendet?
5. Beschreiben Sie bitte die Organisation der, mit dem Bereich verbundenen Ressourcen.
  - Anzahl der mit dem Anlagebereich befassten Mitarbeiter
  - Zeit in % der gesamten Arbeitszeit der genannten Mitarbeiter, die auf den Anlagebereich verwendet wird
  - Spezifische Erfahrung/Qualifikation der Mitarbeiter in Bezug auf die Thematik

## INVESTMENTPROZESS AKTIEN

### Portfoliokonstruktion

1. Wie ist die Portfoliokonstruktion für Aktienanlagen gestaltet und welche Idee verfolgen Sie damit?
2. Welche Strategien ( Regionen/Stile/Sektoren/Passiv) haben Sie investiert und wann erfolgte das erste Investment? Welche Gründe sprachen aus Ihrer Sicht für die jeweilige Strategie?

### Selektion

1. Wie und nach welchen Kriterien erfolgt die Managerauswahl?
2. Haben Sie spezifische\* Kriterien, die nur in diesem Bereich Anwendung finden? (\*ESG- Kriterien werden im letzten Abschnitt des Moduls noch gesondert abgefragt)
3. Wie verfolgen Sie das Universum an zur Verfügung stehenden Managern?

4. Wurde ein Berater/Spezialist involviert ( intern/extern)?
5. Falls Sie ein eigenes Aktienmanagement haben: Wie sind das Team/ die zur Verfügung stehenden Ressourcen aufgestellt? Welche Strategie wird verfolgt? Wie erfolgt die Aktienselektion? Wo sehen Sie Ihren Wettbewerbsvorteil?

### Implementierung

In welche Strukturen bzw. Vehikelformen wurde investiert? ( Spezialfonds, UCITS, Dachfonds, Swap, Optionen etc.) Begründen Sie bitte kurz die Wahl der Strukturen/ Vehikel

### Controlling und Risikomanagement

1. Wie und in welchem Turnus ist die Informationsversorgung organisiert?
2. Welche Informationen/Exposures erheben Sie und welche Rückschlüsse lassen sich aus diesen Daten ziehen?
3. In welcher Frequenz erfolgt der Kontakt zu den eingesetzten Managern?
4. Wo sehen Sie die größten Risiken (quantitativ/qualitativ)?
5. Welche Vorkehrungen haben Sie getroffen, um diese Risiken angemessen zu überwachen und zu steuern?
6. Wie gehen Sie mit Währungsrisiken um?

## ESG-FOKUS

1. Haben Sie Anlagerichtlinien nach ESG-Aspekten für Ihre Kapitalanlagen definiert und wie sehen diese aus? Inwieweit orientieren sich diese an der EU-Taxonomie?
2. Welches sind die drei wichtigsten Ziele, die Sie damit für Ihr Unternehmen und für die Gesellschaft verfolgen (Risikomanagement, Reputation etc.)?
3. Gehen Sie auf Ihr Nachhaltigkeitskonzept bzw. auf Ihre Auswahlmethoden ein (z.B. negatives Screening, Best-in-Class, Integration etc.)
4. Beschreiben Sie Ihren Anlageprozess in Bezug auf die Implementierung von ESG-Kriterien
5. Wird Ihr Aktien-Portfolio einer ESG-Analyse unterzogen und wie?
6. Wie ist Ihr (internes oder externes) ESG-Research aufgestellt?
7. Haben Sie Richtlinien zur Stimmrechtsausübung und im Idealfall eine eigene Proxy-Voting-Zuständigkeit?