

FRAGEMODUL

ZUR BEWERBUNG UM DEN DPN-AWARD INSURANCE ASSET MANAGEMENT 2022 MIT BESONDEREM FOKUS AUF ESG-KRITERIEN

Mit dem Award wird im Sinne einer Gesamtwertung das überzeugendste Anlagemanagement in der Institutionsklasse Versicherungskonzerne ausgezeichnet unter Berücksichtigung der institutionspezifischen Zielsetzungen, der bilanziellen Vorgaben bzw. des jeweiligen regulatorischen Regimes. Ein besonderer Fokus wird bei der Bewertung auf der Berücksichtigung 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, 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: _____

EINLEITUNGSTEIL

DES FRAGEMODULS ZUM DPN-AWARD INSURANCE ASSET MANAGEMENT 2022

- 1.** Wie ist der Geschäftsbetrieb organisiert (Personal, Front-, Middle-, Backoffice, organisatorische Einbettung in einen verbundenen Konzern, externe Dienstleister)
- 2.** Stellen Sie Ihre Portfoliostruktur bitte übersichtsartig dar. Wie hat sich diese seit 2019 verändert?
- 3.** Skizzieren Sie bitte die administrative Struktur Ihrer Kapitalanlagen
- 4.** Skizzieren Sie die Performance Ihrer Kapitalanlage in den Jahren 2019, 2020 und 2021, differenziert nach laufendem Netto-Ertrag (d.h. abzüglich KA-Kosten), außerordentlichem Netto-Ertrag (Gewinne, Verluste, Zu- und Abschreibungen) sowie Veränderung der Bewertungsreserven incl. aller entsprechenden Prozentsätze.

HAUPTTEIL

DES FRAGEMODULS ZUM **DPN-AWARD** **INSURANCE ASSET MANAGEMENT 2022**

1. Erläutern Sie am Beispiel des Jahres 2021, welche – versicherungsseitigen und unternehmenspolitischen – Zielvorgaben für das Asset Management gelten und wie diese ermittelt werden.
2. Erläutern Sie Ihren SAA-Prozess, mit dem Sie die Kapitalanlage auf die Zielvorgaben gemäß 1) ausrichten.
3. Beschreiben Sie, nach welchen Regeln und in welchem Umfang Sie Asset-Management-Aufgaben externen Dienstleistern zuweisen und wie Sie diese steuern. Beschreiben Sie anhand eines Beispiels die Auswahl eines externen Asset-Management-Dienstleisters.
4. Mit welchen Kennziffern messen Sie das Risiko Ihrer Kapitalanlage und wie steuern Sie diese Risiken?
5. Sofern in Ihrem Unternehmen 2021 Gewinnrealisierungen zur Stärkung der versicherungstechnischen Rückstellungen vorgenommen wurden: Nach welchen Kriterien haben Sie die zu verkaufenden Assets ausgewählt und die Erlöse wieder angelegt?
6. Haben Sie 2021 besondere Maßnahmen umgesetzt, um die Zinssensitivität Ihrer Kapitalanlage oder andere Risiken zu reduzieren? Bitte erläutern Sie dies anhand von Beispielen.
7. Haben Sie 2021 mit besonderen Maßnahmen in der Kapitalanlage dazu beigetragen, die SCR-Anforderungen Ihres Unternehmens zu reduzieren? Bitte erläutern Sie dies anhand von Beispielen.
8. Hat Ihr Asset Management 2021 Beiträge zur Entwicklung von Versicherungsprodukten mit reduzierten Garantieforderungen geleistet? Bitte erläutern Sie dies anhand von Beispielen.

ESG-FOKUS

FRAGEMODUL ZUM DPN-AWARD INSURANCE ASSET MANAGEMENT 2022

1. Haben Sie Anlagerichtlinien nach ökologischen, sozialen und Governance-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, insgesamt und nach Anlageklassen.
5. Werden ESG-Richtlinien auf Ihr gesamtes Anlageportfolio angewandt oder nur auf bestimmte Anlagebereiche? Im letzteren Fall benennen Sie bitte die Bereiche und die Gründe für die Schwerpunktsetzung.
6. Wie haben sich die Volumina der nachhaltigen Investments in den vergangenen 3 Jahren entwickelt?
7. Welcher Prozentsatz Ihres Portfolios wird einer ESG-Analyse unterzogen?
8. Wie ist Ihr (internes oder externes) ESG-Research aufgestellt?