

FRAGEMODUL

ZUR BEWERBUNG UM DEN DPN-AWARD RISIKOMANAGEMENT UND ASSET-LIABILITY-MANAGEMENT 2022

Mit dem Award werden weiterentwickelte und effiziente Risikomanagementstrategien und ALM-Modelle ausgezeichnet sowie deren gelungene strategische und operative Umsetzung. Mit dem Award wird im Sinne einer Gesamtbewertung das überzeugendste Anlagemanagement in der Institutionsklasse Pensionskassen und Versorgungswerke ausgezeichnet unter besonderer Berücksichtigung der institutionsspezifischen 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 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 Redaktionen 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: _____

Risikoanalyse/Struktur

1. Welchen externen und internen Anforderungen an das Risikomanagement unterliegt Ihre Institution?
2. Wie wird die Risikotragfähigkeit ermittelt? Unterscheiden Sie zwischen struktureller und finanzieller Risikotragfähigkeit.
3. Welche Arten von Risiken werden auf den verschiedenen Ebenen der Kapitalanlage adressiert? (Strukturelle Risiken, asset-klassen-spezifische Risiken, manager-spezifische Risiken etc.)
4. Wie werden diese jeweils analysiert (qualitativ, quantitativ, Kennzahlen)?
5. Wie werden diese konsolidiert/gesteuert? Welche Bedeutung hat dabei insbesondere das aktive Management und wie wird der Beitrag des aktiven Managements zum Gesamtrisiko gesteuert?

ALM (Modell, Kultur und Prozess)

1. Wodurch ist das ALM in Ihrer Institution/Ihrem Unternehmen insbesondere geprägt?
2. Wo liegt in Ihrer Institution/Ihrem Unternehmen die Hauptverantwortung für das ALM? In welchen Organisationseinheiten wird das ALM im Wesentlichen ausgestaltet und welche Einheiten wirken mit?
3. Wie sieht Ihr ALM-Prozess aus?
4. Wie ist Ihr Berichtswesen organisatorisch und inhaltlich gestaltet? Wie regelmäßig berichten Sie gegenüber dem Vorstand über Ergebnisse des ALM?
5. Bei Vorstandsentscheidungen zu welchen Themen haben Sie im letzten Jahr explizit oder implizit auf Erkenntnisse Ihres ALM zurückgegriffen?
6. Welches sind die wichtigsten Kenngrößen Ihres ALM?
7. Welche Anpassungen Ihres ALM haben Sie im letzten Jahr vorgenommen?
8. Wie oft erstellen Sie ALM-Studien? Wie integrieren Sie diese in Ihre Entscheidungsprozesse?

Umsetzung (Risikomanagement & ALM)

1. Welche Regeln/Mechanismen bestehen, falls Risikolimits überschritten werden?
2. Wurden Maßnahmen zur Erhöhung der Risikotragfähigkeit ergriffen oder sind diese vorgesehen?
3. Wie gehen Sie mit Risiken um, die (noch) nicht erwartet oder modelliert sind?
4. Wie werden operationelle Risiken berücksichtigt?
5. Welche Anlässe könnten zu ad-hoc-Risiko-Meldungen führen und wie werden diese ggf. umgesetzt?
6. Wie kommunizieren Sie die Ergebnisse Ihres Risikomanagements ggü. Ihren „Stakeholdern“? Welchen Herausforderungen stehen Sie dabei gegenüber?

7. Beschreiben Sie die Zusammenarbeit von Aktiv- und Passivseite in Ihrem ALM? Wer ist dabei federführend?
8. Welche Zusammenhänge bestehen in Ihrer Institution zwischen ALM und..
 - ..Risikomanagement?
 - ..versicherungsmathematischer Funktion?
 - ..Prognoserechnung?
 - ..Stresstest?
 - ..Rechnungswesen/Finanzbuchhaltung?
9. Welche Managementregeln setzen Sie ein..
 - ..für die Aktivseite?
 - ..für die Passivseite?
 - ..für die Zusammenhänge zwischen Aktiv- und Passivseite?
10. Welche Tools und Instrumente setzen Sie für Ihr ALM ein? Welche davon haben Sie selbst entwickelt, welche haben Sie von externen Dienstleistern übernommen? Welche Schwachstellen sehen Sie bei diesen Instrumenten und wie gehen Sie damit um?