

FRAGEMODUL

ZUR BEWERBUNG UM DEN **DPN-AWARD** **PENSION ASSET MANAGEMENT 2022 IN VERSORGUNGSWERKEN** **UND PENSIONSKASSEN MIT BESONDEREM FOKUS AUF ESG-KRITERIEN**

Mit dem Award wird im Sinne einer Gesamtwertung 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 der Bewertung wird 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 der 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** **PENSION ASSET MANAGEMENT 2022 IN VERSORGUNGSWERKEN** **UND PENSIONSKASSEN**

1. Beschreiben Sie die Art Ihrer Versorgungsverpflichtungen (Leistungsplangestaltung, Pflichtversicherungen vs. Freiwillige Versicherungen). Geben Sie bitte die Anzahl der Versorgungsberechtigten an (Anwärter/Rentner/Ausgeschiedene).
2. Wie ist der Geschäftsbetrieb organisiert? (Personal, Front-, Middle-, Backoffice, organisatorische Einbettung in einen verbundenen Konzern)
3. Welche Besonderheiten bestehen in den regulatorischen Rahmenbedingungen?
4. Stellen Sie bitte die Eigenmittelausstattung dar (Solvabilitätsquote, echte Eigenmittel vs. Surrogate)
5. In welcher Relation standen Einzahlungen zu Auszahlungen aus Pensionsplänen im letzten Geschäftsjahr?
6. Stellen Sie bitte übersichtsartig Ihre Portfoliostruktur dar
7. Skizzieren Sie bitte die administrative Struktur der Kapitalanlagen
8. Stellen Sie die Auslastung der Quoten nach der Anlageverordnung dar

HAUPTTEIL

DES FRAGEMODULS ZUM **DPN-AWARD** **PENSION ASSET MANAGEMENT 2022 IN VERSORGUNGSWERKEN** **UND PENSIONSKASSEN**

1. Was sind die zentralen Elemente der Anlagephilosophie Ihrer Versorgungseinrichtung, und wie werden diese in der Umsetzung erkennbar?
2. Stellen Sie Besonderheiten Ihrer Portfoliostruktur dar, die aus Ihrer Sicht Differenzierungsmerkmale zu Ihrer Peergroup aufweisen.
3. Beschreiben Sie die strategische Planung für die Kapitalanlagen. Wie gelangen Sie insbesondere zu den Zielvorgaben und Toleranzen für die Kapitalanlage?(Wie) werden dazu Methoden wie ALM Studien, Forecastmodelle u.a. genutzt?
4. Welche Funktion hat der Direktbestand in der Anlagestrategie? Wie ist er strukturiert? Wie wird er bewirtschaftet?.
5. Wie werden liquide, traditionelle Asset-Klassen bewirtschaftet? Welche Mandatstypen werden eingesetzt und welche Profile haben diese? Was wird intern bzw. extern umgesetzt?
6. Wie werden Alternatives bewirtschaftet? Beschreiben Sie bitte Strategie, Umsetzung und Stil der Bewirtschaftung. Untergliedern Sie bitte nach liquiden und illiquiden Alternatives. Falls Sie nicht in Alternatives investiert sind, nennen Sie die Gründe.
7. Wann wurde zuletzt eine neue Asset-Klasse besetzt? Wie wurde die Entscheidung begründet? Wie wurde die neue Asset-Klasse implementiert?
8. Wie werden die zentralen Risiken der Versorgungseinrichtung überwacht und gesteuert? Wie ist das Risikomanagement organisatorisch aufgebaut und welche Befugnisse hat es? Welches sind Ihre wichtigsten Maßnahmen zur Gewährleistung der Risikotragfähigkeit der Versorgungseinrichtung?
9. **a.** nur für Pensionskassen: Bieten Sie Lösungen für die reine Beitragszusage im Rahmen von Sozialpartnermodellen an und wenn ja, wie setzen Sie dies im Bereich der Kapitalanlage um?
b. Was hat sich im Hinblick auf Ihre Geschäftsorganisation und im Risikomanagement geändert?
10. Wie wird der Erfolg der Versorgungseinrichtung gemessen?
11. Wie sind die Compliance-Regeln für die Institution und die Mitarbeiter verankert?

ESG-FOKUS

FRAGEMODUL ZUM DPN-AWARD

PENSION ASSET MANAGEMENT 2022 IN VERSORGUNGSWERKEN UND PENSIONSKASSEN

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. Erläutern Sie bitte Ihr Nachhaltigkeitskonzept bzw. Ihre Auswahlmethoden (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?