**portfolio institutionell Awards 2020**

Die wichtigste Auszeichnung für institutionelle Investoren in Deutschland

2./3. April 2020 in Berlin

**Fragebogen zur Award-Kategorie**

**Beste Bank**

Fokus: Gesamtbanksteuerung und Eigenanlage

****

**Mitglieder der Award-Jury:**

Prof. Dr. Jens Kleine, Hochschule München (Lead)

Volker Liermann, ifb

Prof. Dr. Friedrich Thießen, TU Chemnitz

Prof. Dr. Stefan Zeranski, Ostfalia Hochschule für angewandte Wissenschaften

**Mitglieder des akademischen Beirats:**

Prof. Dr. Rüdiger Kiesel, Universität Duisburg-Essen

Prof. Dr. Gunter Löffler, Universität Ulm

Prof. Stefan Mittnik, Ludwig-Maximilians-Universität München

**Lead des akademischen Beirats:**

Prof. Dr. Thomas Heidorn, Frankfurt School of Finance & Management

Hinweise zur Bearbeitung

Der Fragebogen ist in mehrere Abschnitte gegliedert. Die Abschnitte I und II dienen der Erfassung allgemeiner Informationen. Ab dem Abschnitt III beschäftigt sich der Fragebogen mit den speziellen Fragen zur Award-Kategorie „Beste Bank“.

**Die Bilanz- und Kennzahlen sollen maximal das 3. Quartal 2019 betreffen. Die Antwort soll bei normaler Schrift inklusive Anlagen 10 - 15 Seiten umfassen. Spätester Abgabetermin ist der 15. Januar 2020.**

Am praktischsten und einfachsten ist es, wenn Sie das Word-Dokument des entsprechenden Fragebogens kopieren und zur Beantwortung nutzen. Bei Fragen wenden Sie sich bitte an portfolio institutionell, Thomas Bauer, unter +49 (0) 69 8570 8132. Bitte schicken Sie den beantworteten Fragebogen per E-Mail an: t.bauer@portfolio-verlag.com. Natürlich können Sie ihn uns auch per Post senden an: portfolio Verlagsgesellschaft mbH, Kleine Hochstraße 9–11, 60313 Frankfurt.

Compliance-Regeln

Compliance-Regeln, auf die sich die Jury-Mitglieder verständigt haben:

Das Komitee-Mitglied enthält sich der Stimme, wenn eine laufende, signifikante Geschäftsbeziehung zum Kandidaten besteht und / oder konkrete Abschlüsse mit dem Kandidaten bevorstehen. Sollte dies der Fall sein oder ein anderweitiger Interessenkonflikt vorliegen, verpflichtet sich das Jury-Mitglied, dies der Jury gegenüber anzugeben.

Gewonnene Erkenntnisse und Informationen werden vertraulich behandelt, in keinem Falle für eigene Zwecke verwendet, weitergegeben oder gar veröffentlicht und nach der Auswertung gelöscht und vernichtet. Die Angaben sind ausschließlich der Projektleiterin der Awards, der Jury sowie dem akademischen Beirat zugänglich.

Disclaimer Teilnehmer

Die im Rahmen des Auswahlverfahrens zu den portfolio institutionell Awards 2020 eingetragenen Daten und Angaben sind nach bestem Wissen und Gewissen und nach dem aktuellen Sachstand gemacht.

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

**Unterschrift Teilnehmer/Datum**

**Fragebogen zur Award-Kategorie**

**Beste Bank**

Fokus: Treasury

**I. Kontakt**

1. Name der Institution / Einrichtung
2. Name des Ansprechpartners
3. Position des Ansprechpartners
4. Anschrift
5. E-Mail
6. Telefon (Durchwahl des Ansprechpartners)

**II. Institution / Einrichtung - allgemein**

1. Geben Sie bitte einen Überblick über Ihre Institution / Einrichtung. Erläutern Sie bitte entsprechend Ihrer Geschäftsstrategie die Haupttätigkeitsbereiche und die Schwerpunktsetzung in der Geschäftspolitik.

Bitte beantworten Sie auch folgende Fragen:

1. Bilanzsumme in Mio. Euro:

2019 / (3.) Quartal

2018

2017

1. Summe und Prozentsatz der Forderungen an Kunden gemessen an der Bilanzsumme:
2. Volumen und Prozentsatz der Eigenanlagen an der Bilanzsumme:
3. Wie sehen die Erträge und GuV-Belastungen aus dem Depot A in den letzten drei Jahren in Ihrem Hause aus?
4. Wie hoch ist der Anteil des Strukturbeitrags (Meldung gemäß FinaRisikoV) am Betriebsergebnis vor und nach Bewertung?
5. Organisation der für die Eigenanlagen (Handel / Treasury) zuständigen Bereiche:

**III. Institut im Speziellen – Gesamtbanksteuerung**

1. Erläutern Sie bitte Ihre Handelsstrategie.
2. Erläutern Sie bitte Ihre Risikostrategie und Ihre Liquiditätsstrategie. Gehen Sie dabei auf die Sicherung der Nachhaltigkeit des Geschäftsmodells ein.
3. Welche Steuerungsphilosophie, Risikoanalysemethoden und Stresstests setzen Sie in Ihrem Hause in den folgenden Bereichen ein:

* Marktpreisrisiko-Steuerung im Zinsbuch und Depot A?
* Adressrisikosteuerung im Kundenkreditgeschäft und Depot A?
* Liquiditätsrisiko-/Liquiditätskosten-Steuerung?
* Steuerung der Immobilienrisiken (Einzelobjekt und Portfoliobetrachtungen)?
* Steuerung operationeller Risiken?
* Steuerung von Vertriebsrisiken?

**IV. Institut im Speziellen – Eigenanlagen**

1. Beschreiben Sie bitte die Asset Allocation Ihrer Eigenanlagen bzw. im Depot A und führen Sie dabei auch die genutzten Vehikel an (z.B. eigengemanagte Anlagen, Publikumsfonds, strukturierte Produkte etc.).
2. Wie sind die Eigenanlagen in die strategische Planung in Ihrem Hause einbezogen und welche Ziele wollen Sie mit den Eigenanlagen erreichen?
3. Erklären Sie bitte die eventuelle Einbindung externer Asset Manager und deren Auswahl bzw. warum Sie darauf verzichten?
4. Wie fließt das Risiko in die Performance-Analyse ein (z.B. welche Risk-adjusted-Return-Kennziffern kommen zum Einsatz)?
5. Wie steuern Sie die Risiken in Ihren Eigenanlagen aus?
6. Welche Aspekte und Komponenten Ihres Prozesses für die Eigenanlagen verdienen besondere Würdigung?

**V. Institut im Speziellen – Innovationen**

1. Haben Sie in den vergangenen zwölf Monaten intern einen für Sie innovativen Investmentansatz (bspw. durch den Einsatz von Künstlicher Intelligenz, Machine Learning oder anderer statistischer Methoden) oder ein Asset-Management-Produkt in das Portfoliomanagement aufgenommen / eingebunden?
2. Wenn ja, wie ist dieser Investmentansatz / das Asset-Management-Produkt ausgestaltet und wie wurde der Prozess umgesetzt? Wie wird dabei in der Performance-Bewertung der Aspekt der Nachhaltigkeit im Sinne einer Mehrperiodenbetrachtung behandelt?

Darf Sie die Award-Jury für ggf. auftretende Rückfragen kontaktieren?

 Ja

 Nein

Falls Sie Rückfragen zu Ihrer Teilnahme oder zum Ausfüllen des Fragebogens haben, wenden Sie sich bitte an:

Thomas Bauer

portfolio institutionell

T: +49 (0) 69 8570 8132

E-Mail: t.bauer@portfolio-verlag.com

Herzlichen Dank für Ihre Beteiligung an den portfolio institutionell Awards 2020 –

die bedeutendste Auszeichnung für institutionelle Investoren in Deutschland.