**portfolio institutionell Awards 2020**

Die wichtigste Auszeichnung für institutionelle Investoren in Deutschland

2./3. April 2020 in Berlin

**Fragebogen zur Award-Kategorie**

**Beste Versicherung**

Fokus: Management der Kapitalanlagen



**Mitglieder der Award-Jury:**

Dieter Wolf, Orchidee Advisory (Lead)

Prof. Dr. Jens Kleine, Hochschule München

Prof. Dr. Niklas Wagner, Universität Passau

**Mitglieder des akademischen Beirats:**

Prof. Dr. Rüdiger Kiesel, Universität Duisburg-Essen

Prof. Dr. Gunter Löffler, Universität Ulm

Prof. Dr. 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 Kategorie „Beste Versicherung“.

**Die Bilanz- und Kennzahlen sollen maximal das 3. Quartal 2019 betreffen. Die Antwort soll bei normaler Schrift inklusive Anlagen 10 - 12 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

Ein Jury-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 Daten und Angaben im ausgefüllten Fragebogen zur Teilnahme am Auswahlverfahren der portfolio institutionell Awards 2020 wurden nach bestem Wissen und Gewissen und nach dem aktuellen Sachstand eingetragen.

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

**Unterschrift Teilnehmer/Datum**

**Fragebogen Beste Versicherung**

Fokus: Management der Kapitalanlagen

**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 (max. 250 Wörter/Antwort)**

1. Geben Sie bitte einen kurzen Überblick über Ihre Institution / Einrichtung.
2. Beschreiben Sie die Organisation der für die Kapitalanlagen zuständigen Bereiche.
3. Kapitalanlagen in Mio. Euro

*(falls auch fondsgebundenes Geschäft angeboten wird, bitte die Kapitalanlagen nach klassischem und fondsgebundenen Geschäft unterteilen)*

Für 2019 genügen auch Tendenzen:

2019 / (2. oder 3. Quartal)

2018

2017

1. Renditen (für die Kapitalanlagen aus klassischem Versicherungsgeschäft):

Durchschnittsverzinsung der Kapitalanlagen in Prozent

2019 / (2. oder 3. Quartal)

2018

2017

Nettoverzinsung der Kapitalanlagen in Prozent

2019 / (2. oder 3. Quartal)

2018

2017

Total Return der Kapitalanlagen in Prozent

2019 / (2. oder 3. Quartal)

2018

2017

1. Kennzahlen:

Gesamtreserven Kapitalanlagen in Prozent der Kapitalanlagen

2019 / (2. oder 3. Quartal)

2018

2017

Freie RfB in Prozent der Kapitalanlagen

2019 / (2. oder 3. Quartal)

2018

2017

**IIl. Versicherung im Speziellen (max. 250 Wörter/Antwort)**

1. Beschreiben Sie die Zielsetzung und Ihre Philosophie bei der Verwaltung Ihrer Kapitalanlagen.
2. Welchen Einfluss haben die regulatorischen Rahmenbedingungen auf Ihr Asset-Liability-Management und die Struktur Ihrer Kapitalanlagen?
3. Wann wurde das Asset-Liability-Management in der heutigen Form eingeführt, und was sind die wesentlichen Spezifika?
4. Wann wurde der Investmentprozess zur Kapitalanlagesteuerung eingeführt? Erläutern Sie Ihren Investmentprozess sowohl für die intern verwalteten Direktanlagen und Mandate als auch für die extern verwalteten Mandate. Bitte gehen Sie dabei auf wesentliche Prozessbestandteile an wie:

* strategische und taktische Asset-Allokation
* Anreizsystem für interne und externe Portfoliomanager
* Vorgehensweise bei der Vergabe bzw. dem Entzug von Mandaten

1. Wie sieht die Struktur Ihrer Kapitalanlagen (Asset-Allokation) im Einzelnen aus?
2. Welchen Anteil Ihrer Kapitalanlagen lassen Sie extern verwalten?
3. Welche Assets (Anlageklassen) werden extern verwaltet?
4. Nach welchen Kriterien entscheiden Sie über internes bzw. externes Management?
5. Mit welchen Anlageinstrumenten und -strategien haben Sie in den letzten drei Jahren Überrenditen erzielt?
6. Wie stellen Sie das notwendige interne und externe Know-how, auch von Asset Managern und Beratern, und die dazugehörige Qualitätssicherung dar?
7. Wie sind Ihr Risikomanagement und Ihr Risikocontrolling aufgesetzt?
8. Zu welchen Überlegungen und ggf. Konsequenzen haben Finanzkrise und Schuldenkrise bei Ihnen hinsichtlich Ihrer Kapitalanlagen und / oder Ihres Risikomanagements geführt?
9. Gibt es weitere Aspekte, die Sie in Ihrem Kapitalanlage- und Risikomanagement für erwähnenswert halten? Welche Überlegungen und Ansätze verdienen hierbei besondere Würdigung?
10. Welche neuen Produkte in der Lebensversicherung haben Sie im Angebot, um die Niedrigzinsphase zu überwinden?

**IV. Gewinnbeteiligung (max. 250 Wörter)**

Bitte zeigen Sie Gewinnbeteiligungen je Produktgruppe in einer Zusammenfassung auf.

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](mailto:t.bauer@portfolio-verlag.com)

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

die bedeutendste Auszeichnung für institutionelle Investoren in Deutschland.