**portfolio institutionell Awards 2020**

Die wichtigste Auszeichnung für institutionelle Investoren in Deutschland

2./3. April 2020 in Berlin

**Fragebogen zur Award-Kategorie**

**Bestes Risikomanagement**

Fokus: Organisation, Analyse und Prozess



**Mitglieder der Award-Jury:**

Martin Schliemann, FFA Frankfurt Finance Audit (Lead)

Rüdiger Seiffert, Rüdiger Seiffert Consulting

Prof. Dr. Arnd Wiedemann, Universität Siegen

**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 Award-Kategorie „Bestes Risikomanagement“.

**Der ausgefüllte Fragebogen soll bei Times New Roman 12 pt 10 - 15 Seiten umfassen. Bitte verzichten Sie auf Anlagen! Sofern Sie Kennzahlen präsentieren möchten, sollten sich diese ausschließlich auf das 3. Quartal 2019 beziehen. 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 Bestes Risikomanagement**Fokus: Organisation, Analyse und Prozess

1. **Kontakt**
2. Name der Einrichtung/Institution
3. Name des Ansprechpartners
4. Position des Ansprechpartners
5. Anschrift
6. E-Mail
7. Telefon (Durchwahl des Ansprechpartners)
8. **Institution/Einrichtung – allgemein (max. 1 Seite)**

Geben Sie einen kurzen Überblick über Ihre Institution/Ihre Einrichtung.

1. **Risikokultur (max. 3 Seiten)**
   1. Beschreiben Sie die Ihrem Risikomanagement zugrunde liegende Philosophie und Risiko­kultur. Gehen Sie auch kurz auf den Zusammenhang zu Ihrem Geschäftsmodell ein.
   2. Beschreiben Sie, wie Ihr Risikomanagement in die Geschäfts- bzw. Anlageentscheidungen eingebunden ist.
2. **Risikomanagement – Analyse (max. 5 Seiten)**
   1. Welche wichtigen Risikoarten werden in Ihrem Ansatz unterschieden und behandelt? Wie werden ökonomische, bilanzielle und regulatorische Risiken abgebildet?
   2. Wie werden Risiken in Ihrem Risikomanagement gemessen und bewertet? Bitte skizzieren Sie die genutzten qualitativen und quantitativen Methoden und zeigen Sie wesentliche Kennzahlen auf.
   3. Wie gehen Sie mit Risiken um, die (noch) nicht erwartet oder nicht modelliert sind?

1. **Risikomanagement – Organisation, Prozess und Umsetzung (max. 7 Seiten)**
2. Wie ist das Risikomanagement hinsichtlich seiner technischen und personellen Kapazitäten und Fähigkeiten ausgestattet – intern und/oder extern? Wie sind die Verantwortlichkeiten für das Risikomanagement verteilt? Welche Qualifikationen haben die verantwortlichen Mitarbeiter?
3. Binden Sie in Ihren Risikomanagementprozess externe Dienstleister mit ein? Wenn ja, welche Kriterien beeinflussen oder bedingen eine Auslagerung? Wie gehen Sie bei der Auslagerung vor und welche Aktivitäten erfolgen zur Qualitätssicherung?
4. Erläutern Sie bitte die zentralen Prozesse in Ihrem Risikomanagement. Inwiefern sind diese besonders geeignet, den externen und internen Anforderungen an das Risikomanagement zu entsprechen? Bitte illustrieren Sie deren Wirkung auch unter Bezugnahme auf das aktuelle Marktumfeld.
5. Welche wesentlichen Weiterentwicklungen Ihres Risikomanagements gab es in den letzten 24 Monaten? Wie wurden diese initiiert?

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.