**portfolio institutionell Awards 2021**

Die bedeutendste Auszeichnung für institutionelle Investoren in Deutschland

17. Juni 2021 in Berlin

**Fragebogen zur Award-Kategorie**

**Beste Portfoliostruktur**

Fokus: Strategische und taktische Asset Allocation, Diversifikation, Risiko-Controlling



**Mitglieder der Award-Jury:**

Jürgen Huth, Faros Consulting (Lead)

Prof. Dr. Dirk Söhnholz, Diversifikator GmbH

Prof. Dr. Klaus Schäfer, Universität Bayreuth

**Mitglieder des akademischen Beirats:**

Prof. Rüdiger Kiesel, Universität Duisburg-Essen

Prof. 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 Portfoliostruktur“.

**Die Bilanz- und Kennzahlen sollen maximal das 4. Quartal 2010 betreffen. Die Antwort soll bei normaler Schrift maximal 7 bis 10 Seiten umfassen. Spätester Abgabetermin ist der Spätester Abgabetermin ist der 10 April 2021.**

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 2021 wurden nach bestem Wissen und Gewissen und nach dem aktuellen Sachstand eingetragen.

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

**Unterschrift Teilnehmer/Datum**

**Fragebogen Award-Kategorie**

**Beste Portfoliostruktur**

Fokus: Strategische und taktische Asset Allocation, Diversifikation, Risiko-Controlling

**I. Kontakt**

* Name der Institution / Einrichtung
* Name des Ansprechpartners
* Position des Ansprechpartners
* Anschrift
* E-Mail
* Telefon (Durchwahl des Ansprechpartners)

**II. Institution / Einrichtung – allgemein**

1. Geben Sie bitte einen Überblick über Ihre Institution / Einrichtung
2. Kapitalanlagen: Gesamtvolumen (Marktwerte) in Mio. Euro, Ultimo

2020 / 4. Quartal

2019

2018

1. Performance der Kapitalanlagen (annualisierte Nettorendite und Standardabweichung) in Prozent

2020 / 4. Quartal

2019

2018

1. Performance-Ermittlung: Bitte beschreiben Sie kurz, auf welcher Basis bzw. nach welcher Methode die in 3. angegebenen Performance-Kennzahlen ermittelt wurden.
2. Beschreiben Sie bitte die Organisation der für die Kapitalanlage zuständigen Bereiche

**III. Strategische Asset Allocation**

1. Beschreiben Sie bitte die Grundsätze / Philosophie, auf denen Ihre Anlagepolitik aufbaut.
2. Beschreiben Sie die Anlageziele, insbesondere auch die Performanceziele (Rendite / Risiko), die mit der Vermögensanlage verbunden werden, hinsichtlich eines kurzfristigen (bis 12 Monate), mittelfristigen (bis 36 Monate) und darüber hinaus gehenden, längerfristigen Anlagehorizonts. Falls Sie Performancebenchmarks nutzen, geben Sie diese bitte an.
3. Welchen internen bzw. externen Restriktionen[[1]](#footnote-1) unterliegt ggf. die Anlagepolitik? Gibt es Anlagetypen, die durch interne oder externe Vorgaben von einer Investition ausgeschlossen sind? Bitte geben Sie auch minimale/maximale Grenzen für Anlagesegmente (ggf. mit Overlayeinfluß) in der kurz- und mittelfristigen Allokation an, wenn solche genutzt werden.
4. Welche Methoden, Konzepte und Informationsquellen nutzen Sie im Rahmen der Festlegung Ihrer Asset Allocation? Wie kommen Rendite-, Risiko- und Korrelationsprognosen zustande? Wenn Sie nicht von Normalverteilungen ausgehen: Welche Verteilungsannahmen nutzen Sie?
5. Beschreiben Sie bitte die organisatorische Umsetzung des Portfolios unter Berücksichtigung der folgenden Aspekte:
* Internes vs. externes Management
* Aktives vs. passives Management
* Spezialfonds vs. Publikumsfonds
* Spezielle Strukturen (z.B. Overlay-Strukturen, Master-KAGen)
1. Beschreiben Sie bitte anhand der in der folgenden Tabelle bezeichneten Anlageklassen das Zielportfolio / die strategische Asset Allocation (zu verstehen als die mittel- / langfristige Anlagestruktur des Portfolios in prozentualer Aufteilung – sofern eine entsprechende Definition getroffen wurde) und geben Sie im Weiteren die aktuelle Portfoliostruktur bezogen auf die genannten Anlageklassen an:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  |  |  | **Portfoliostruktur****Stichtag: …** |
| **Anlageklasse** | **Zielportfolio/strategische Asset Allocation** | **Mio. EUR** | **Anteil****31.12.XXXX** | **Anteil****Stichtag** |
| Direktanlage (Pfandbriefe, SSD, etc.)Government Bonds/StaatsanleihenCorporate BondsEmerging Market DebtHigh Yields | %%%%% |  | %%%%% | %%%%% |
| Immobilien1. direkt
2. Fonds
 | %%% |  | %%% | %%% |
| Aktien1. Europa
2. International
 | %% |  | %% | %% |
| Wandelanleihen | % |  | % | % |
| Darlehen | % |  | % | % |
| Private Equity / Beteiligungen\*1. direkt
2. Fonds
 | %%% |  | %%% | %%% |
| Hedgefonds1. Single-Hedgefonds
2. Dach-Hedgefonds
 | %%% |  | %%% | %%% |
| Absolute Return (UCITS) | % |  | % | % |
| Strukturierte Produkte | % |  | % | % |
| Rohstoffe | % |  | % | % |
| Liquidität | % |  | % | % |
| Infrastruktur / Renewables (Equity) | % |  | % |  |
| Sonstiges | % |  | % | % |
| Gesamt | 100 % |  | 100 % | 100 % |

**IV. Controlling**

1. Auf welche Weise und mit welcher Frequenz erfolgt eine Überprüfung der strategischen Anlagepolitik?
2. Welche Kennzahlen zur Performance-Messung (Rendite / Risiko) verwenden Sie (kurze Begründung, Zielsetzung)? Gehen Sie in diesem Zusammenhang auf etwaige Unterschiede zwischen verschiedenen Asset-Klassen ein.
3. Auf welche Weise und mit welcher Frequenz erfolgt die Erfolgsmessung des internen bzw. externen Kapitalanlagemanagements?
4. Erläutern Sie bitte kurz Ihr Konzept der Risikosteuerung.

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 2021 –

die bedeutendste Auszeichnung für institutionelle Investoren in Deutschland.

1. ohne Aufsichtsrechtliche Restriktionen [↑](#footnote-ref-1)