**portfolio institutionell Awards 2021**

Die bedeutendste Auszeichnung für institutionelle Investoren in Deutschland

17. Juni 2021 in Berlin

**Fragebogen zur Award-Kategorie**

**Bester Investor Fixed Income**

Fokus: Management der Kapitalanlagen



**Mitglieder der Award-Jury:**

Ori Gotfrid, bfinance Deutschland (Lead)

Dr. Harald Eggerstedt, Faros Consulting
Prof. Dr. Josef Zechner, Wirtschaftsuniversität Wien

**Mitglieder des akademischen Beirats:**

Prof. Dr. Christoph Kaserer, Technische Universität München

Prof. Dr. Rüdiger Kiesel, Universität Duisburg-Essen

Prof. Stefan Mittnik, PhD, Ludwigs-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 „Bester Investor Fixed Income“.

**Die Bilanz- und Kennzahlen sollen maximal das 4. Quartal 2020 betreffen. Die Antwort soll bei normaler Schrift inklusive Anlagen 10 - 15 Seiten umfassen. 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 Bester Investor Fixed Income**

Fokus: Management der Kapitalanlagen

**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 kurzen Überblick über Ihre Institution / Einrichtung und Ihre Ziele.
2. Höhe der Kapitalanlagen in Mio. Euro gesamt

2020 / (bis Q4)

2019

2018

Höhe der Kapitalanlagen in Renten in Mio. Euro

2020 / (bis Q4)

2019

2018

Anmerkung: Die Kategorie „Fixed Income“ bezieht sich auf Fremdkapitaltitel insgesamt, d.h. Loans, ABS, CDO/CLOs werden in dieser Kategorie berücksichtigt.

1. Wertentwicklung der Kapitalanlagen in Renten und Rentenfonds in Prozent (soweit möglich)

2020 / (bis Q4)

2019

2018

**III. Institution im Speziellen**

Kapitalanlagephilosophie und Umfeld:

1. Beschreiben Sie bitte die Philosophie und Zielsetzung bei der Verwaltung Ihrer Kapitalanlagen im Allgemeinen und bei Renten und Rentenfonds im Besonderen.
2. Wie bestimmen Sie den Anteil der Kapitalanlage in Renten und Rentenfonds?
3. Welche Rolle spielen hierbei aufsichtsrechtliche Vorgaben?
4. Inwieweit wird die Allokation auf der Fixed-Income-Seite durch Solvency-II-Überlegungen beeinflusst (sofern relevant für Ihre Institution / Einrichtung)?

Portfoliostruktur:

1. Bitte geben Sie eine prozentuale Vermögensübersicht zu Ihrem Rentenbestand.
2. Welcher Teil liegt hiervon im Direktbestand, welcher in Fonds?
3. Erläutern Sie bitte Ihren Investmentprozess auf der Rentenseite und gehen Sie u.a. auf folgende Aspekte ein:
4. Wie erfolgt die Asset Allocation in Fremdkapitaltitel?
5. Welche Instrumente werden eingesetzt?
6. Wie erfolgt die Allokation in Fremdwährungsanleihen?
7. Welcher Teil wird intern, welcher extern verwaltet?
8. Welcher Teil wir aktiv, welcher passiv verwaltet?
9. Welche Rolle spielt die Durationssteuerung in Ihrem Portfolio?
10. Investieren Sie in „alternative“ Fremdkapitaltitel wie Private Debt, ABS oder CDOs/CLOs?
11. Wie werden Kreditrisiken eingesetzt und kontrolliert?
12. Wie ist das Risikomanagement in den Prozess eingebunden?
13. Welchen Stellenwert hat das Thema ESG in Ihrem Hause und wie werden ESG Aspekte auf der Fremdkapitalseite umgesetzt.
14. Woran wird der Erfolg Ihrer Anlagepolitik gemessen?

Anmerkung: Bitte gehen Sie insbesondere auf Entwicklungen in den letzten 24-36 Monaten ein*.*

**Zusammenfassung und Ausblick:**

1. Stellen Sie bitte abschließend dar, warum Sie Ihrer Meinung nach besonders erfolgreich im Anlagemanagement von festverzinslichen Wertpapieren sind.
2. Welche Veränderungen planen Sie in Zukunft für Ihr Fixed-Income-Portfolio?
3. Welche Innovationen in Ihrem Fixed-Income-Portfolio möchten Sie abschließend hervorheben?

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.