

Pensionsfondsreporting  
Kapitalanlagen steuern und Berichtspflichten erfüllen.



# Liefert Entscheidungsträgern in Versorgungseinrichtungen umfassende steuerungsrelevante Kapitalanlageberichte und unterstützt das regulatorische Reporting.

Die optimale Risiko- und Performance-Steuerung von Kapitalanlagen zur Deckung von Pensionsverpflichtungen und die Erfüllung der Berichtspflichten gegenüber der Finanzdienstleistungsaufsicht und den Gremien stellen hohe Anforderungen an die Versorgungseinrichtungen und ihre Vermögensverwalter. Der Managed-Service-Ansatz von IDS GmbH – Analysis and Reporting Services (IDS) fördert Investitionsentscheidungen und schafft Sicherheit durch ein konsistentes, ganzheitliches und unvoreingenommenes Berichtswesen.

IDS bietet Unternehmen mit bestehenden Contractual Trust Arrangements (CTAs – Pensionstreuhand), Pensionskassen, Pensionsfonds oder Vermögensverwaltern mit Pensionseinrichtungen als Kunden ein umfassendes Reporting in Bezug auf Struktur, Risiko und Performance der Aktiva (Fonds- und Direktanlagen) an. Pensionsverpflichtungen im Rahmen eines Liability-Driven-Investment-Ansatzes werden in die Betrachtungen einbezogen. Die Kapitalanlage betreffende aufsichtsrechtliche Berichtspflichten, z. B. nach der Verordnung über die Anlage des gebundenen Vermögens von Versicherungsunternehmen (Anlageverordnung – AnIV) und den einschlägigen Rundschreiben der Bundesanstalt für die Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin), werden unterstützt.

## Eigenschaften

### Kapitalanlagereporting

- Marktüberblick
- Ausweis der Asset-Allocation der Kapitalanlagen nach Aktien, Renten, Fonds, Immobilien, Beteiligungen usw.
- Darstellung der Kapitalanlagen nach Regionen und Währungen

### Performancerechnung

- Messung der Performance der Fondsanlagen und Direktanlagen und Bereitstellung sowohl von Kontributionsinformationen, bezogen auf die absolute Performance, als auch von Attributionsinformationen zur relativen Performance gegenüber einer Benchmark

### Risikomessung

- Berechnung des Value at Risk von Einzelportfolios, Zwischenaggregaten und für die Gesamtanlagen nach individuell vorzugebender Berichtsstruktur
- Integrierte Darstellung der Marktrisiken der Passivseite bei Liability-Driven-Investment-Ansätzen
- Durchführung von aufsichtsrechtlich geforderten Prognoserechnungen und individuellen Stresstests
- Bereitstellung von Berichten zur Risikopositionierung für die Risiko-Overlay-Steuerung

### Regulatorisches Reporting

- Nachweisungen 670, 671 und 673 sowie Anlagen für Anzeigen und Berichte nach Sammelverfügung vom 21.06.2011
- Vermögensverzeichnisse nach § 66 Abs. 6 VAG und R12/2005 (VA)

### Portfolio Information Cockpit (PICO)

- Bereitstellung eines Online-Tools zur Anzeige sowie zum Download von Beständen, Allokationen und Performance

## Nutzen


- Die homogene Darstellung der Fonds- und Direktanlagen auf einheitlicher Datenbasis stellt konsistente Berichte mit hoher Aussagekraft sicher.
- Die Berichte werden objektiv von neutraler Stelle erstellt und fördern unvoreingenommene Managemententscheidungen.
- Die Neutralität gegenüber Vermögensverwaltern, Kapitalanlagegesellschaften und Depotbanken schafft Entscheidungsfreiräume; so kann beispielsweise die Managerselektion von der Auswahl des Anbieters für das Berichtswesen entkoppelt werden.
- Die maßgeschneiderte Reportingpalette und eine variable Fertigungstiefe erlauben einen Zuschnitt der Managed Services auf die Bedürfnisse des Anwenders.
- Zugang zu Experten-Know-how im regulatorischen Reporting und im Kapitalanlagereporting entlastet die eigenen Fachabteilungen.

## Funktionalitäten

Daten zu den verschiedenen Beständen (u.a. Fonds- und Direktanlagen, Beteiligungen) werden über die Schnittstellen von IDS oder mittels individueller Lieferungen zur Verfügung gestellt. Sie werden konsolidiert, angereichert und standardisiert. In Abhängigkeit von den Kundenwünschen und -bedürfnissen kann eine Vielzahl von Analysen, z. B. die Analyse der Gesamtperformance von Vermögenswerten, Attributionsanalysen, Value at Risk-Berichte, Stresstests sowie Szenarioanalysen für den aggregierten Kapitalanlagebestand und für die einzelnen Portfolios, erstellt werden. Zusätzlich lassen sich die Pensionsverpflichtungen in das Risikoreporting einbeziehen.

Die Servicequalität profitiert von der Fachkompetenz von IDS im Bereich der gesamten Prozesskette, vom Handling unterschiedlichster Daten über die Performance- und Risikoanalyse bis hin zum individuellen Reporting. IDS deckt mit langjähriger branchenspezifischer Erfahrung ein breites Leistungsspektrum aus einer Hand ab.

IDS strebt eine von Fairness und Verbindlichkeit geprägte nachhaltige Partnerschaft an.



Für nähere Informationen rund um das Produkt  
schreiben Sie bitte eine E-Mail an  
[info@investmentdataservices.com](mailto:info@investmentdataservices.com)

Weitere Informationen über IDS und alle  
unsere Produkte finden Sie auf  
[www.InvestmentDataServices.com](http://www.InvestmentDataServices.com)

IDS GmbH – Analysis and Reporting Services  
Königinstraße 28, 80802 München, Deutschland

© IDS GmbH – Analysis and Reporting Services  
Alle Rechte vorbehalten. Alle Angaben ohne Gewähr.  
Juni 2016