



REGTECH | QUANT | FUND-DATA

Wir spezialisieren uns auf die Erstellung regulatorischer Meldeformate und die Berechnung komplexer quantitativer Services sowie der Lieferung hochwertiger Fondsdaten. Zu unseren langjährigen Kunden zählen Kapitalverwaltungsgesellschaften, Banken, Versicherungen, Family-Offices, Körperschaften öffentlichen Rechts sowie Pensions- und Vorsorgekassen bzw. deren Master KVG-Partner.

VAG REPORTING 2.0 FENION GMBH



Stefan Fischer MSc

Managing Partner
Mobile: +43 664 49 79 111



Mag. Nikolaus Sernetz

Managing Partner
Mobile: +43 664 39 39 993



DI Alexander Adamenko

Managing Partner
Mobile: +43 660 70 58 943



VAG 2.0 – SIND SIE BEREIT?

Am 28. Juli 2021 hat die BaFin Neuerungen in den Berichtspflichten für Versicherungsunternehmen und Pensionsfonds gemäß Versicherungsaufsichtsgesetz (VAG) angekündigt. Ab dem 31. Dezember 2021 müssen beaufsichtigte Asset Manager die Reporting Anforderungen von VAG 2.0 erstmals erfüllen. Fenion unterstützt Investoren und Kapitalsammelstellen bei der Erfüllung der aktuellsten Reporting Erfordernissen und spezialisiert sich auf die Produktion und Lieferung sämtlicher Reporting Templates.

VAG 2.0 neue Reporting-Anforderungen für kleine Versicherungsunternehmen und Pensionsfonds in Deutschland

01_Zeile	02_Bezeichnung	03_Textangabe	04_prozent vom Wert der Anteilklasse	05_Zehner
0	Berichtsstichtag			
0a	Name des Fonds/der Anteilklasse			
1	Anzahl der Anteile			
2	Buchwert eines Anteils	ermitteln		
3	Identifizier (ISIN)			
	10 Marktrisikopotential		100,00	
	11 Index / Benchmark			
	12 Index / Benchmark II, ggf. andere Maßgabe			
	13 Nr. der ANV			
	14 Ermessensfrei Ja / Nein			
19	Anteilswert			
19a	Währung des Fonds/der Anteilsklasse			
19b	Anteil der Fremdwährung (Zeitwert)			
	21			
22	Anteil an sog geschlossenen Private-Equity-Fonds (Nr. 13 Bst. b)			
	24 Anteil an REITs			
	25 Anteil an Vermögensfonds (Nr. 14 Bst. c)			
	26 Anteil der Schuldverschreibungen nach Nr. 6, 7 Bst. a, b, c und d			
	27 Anteil der Schuldverschreibungen nach Nr. 7 Bst. c			
	28 Anteil der Schuldverschreibungen nach Nr. 8			
	29 Anteil der (Schuld)schein(Darlehen nach Nr. 3, 4 Bst. a und Forderungen nach Nr. 1 und Nr. 11			
	30 Anteil der anderen Unternehmensdarlehen nach Nr. 4 Bst. c			
32*	Bonität der Anlagen: Investment-Grade I (AAA bis A-)			
33*	Bonität der Anlagen: Investment-Grade II (BBB+ bis BBB-)			
34*	Bonität der Anlagen: Speculative-Grade (BB+ bis B-)			
35*	Bonität der Anlagen: Default Risk / Default (CCC bis D)			
36*	Bonität der Anlagen: Ohne Bonitätseinschätzung			
	41* Anteil der verbleibenden, nicht in Zeile 20-26, 29-31 oder 38			
	42* Anteil an offenen Zertifikaten, die die Anforderungen nach Nr. 17 erfüllen			
	43* Anteil an Hedgefonds- oder an Rohstoffstrukturen gebundene Anlagen			
45c	Übersteigendes Marktrisikopotential = Zeile 10 abzüglich 100%		0,00 20,00	

VAG 2.0 Template



Erfüllung regulatorischer Vorgaben
Alle Reports und Kalkulationen sind nachvollziehbar und können bei Bedarf den Kunden und Wirtschaftsprüfern offengelegt werden.



Hoher Automatisierungsgrad
führt zu bester Datenqualität für unsere Kunden



Keine Implementierungskosten
und kompetitive Konditionen – Abrechnung nur bei tatsächlicher Leistung – keine Mindestgebühren



Look-Through von Subfonds
Wir ermöglichen ein Maximum an Transparenz und schauen bei Bedarf durch alle Fondsstrukturen durch



Umfassender Kundensupport
durch unsere Reporting Experten








VAG 2.0 – WAS IST NEU.

Mit den Adaptierungen zu VAG 2.0 hat die BaFin auf aktuelle Marktentwicklungen reagiert und das Reporting Template für kleine Versicherungen und Pensionsfonds in Deutschland adaptiert. Fenion ist Spezialist im Bereich regulatorisches Reporting und liefert Kunden das ausgefüllte VAG 2.0 Template gemäß den stets aktuellsten Anforderungen. Unsere Reporting Lösung ermöglicht beste Datenqualität und vollständige Nachvollziehbarkeit des Outputs und der zugrunde liegenden Berechnungen zu kompetitiven Konditionen.


NEUIGKEITEN IM BEREICH VAG 2.0

Überarbeitete Templates für VAG 2.0 Datenblatt und Schuldnerliste 

Neue Allokationen zur Klassifizierung von Fonds (Private Equity, Real Estate Funds) 

Neue Klassifizierungen im Bereich Darlehen und Bail-in fähiger Instrumente 

 Neue Identifier von Emittenten (LEI, alternative Identifier) in der Schuldnerliste

 Höhere Anforderungen hinsichtlich der Granularität von Credit Ratings

 Separater Ausweis von Derivaten als Sub-Kategorie

DEUTSCHES MELDEWESEN

Aufsichtsreporting für Fondsanlagen von Versicherern und Pensionsfonds (VAG)

01_Zeile	02_Bezeichnung/Name des Ausstellers (Schuldners) mit Ausnahme derjenigen i.S.v. § 2 Abs. 1 Nr. 15-17 AnlV	03_Textangabe	04_Zeitwert	05_LEI des Ausstellers (Schuldners)	06_WM-Nummer des Ausstellers (Schuldners)	07_sonstiger Identifier des Ausstellers (Schuldners)	08_Summe je Aussteller (prozent vom Wert des Fonds/Anteilsklasse)
a	Berichtszeitraum						
b	Name des Fonds/der Anteilsklasse						
c	Anzahl der Anteile						
d	Buchwert eines Anteils						
e	Identifier (SIN)						
f	Name der Verwaltungsgesellschaft						
g	Sitz der Verwaltungsgesellschaft						
h	Anteilswert						
i	Währung						

VAG 2.0 Schuldnerliste Template



Sie brauchen Unterstützung im Bereich Fondsdurchrechnung und regulatorisches Reporting?

KONTAKTIEREN SIE UNS

KONTAKT



ADRESSE

Mariahilfer Straße 136, 1150 Wien



TELEFON

+43 (1) 908 11 80



EMAIL

office@fenion.at



Mag. Nikolaus Sernetz
Managing Partner

IMPRESSUM

Fenion ist ein Spin-Off von Deloitte Österreich und agiert seit 2017 als unabhängiges Unternehmen. Unsere Dienstleistungen sind im Bereich des regulatorischen Meldewesens für institutionelle Investoren und den dazu notwendigen Datenlieferungen.

KONTAKT

Fenion GmbH
Mariahilfer Straße 136
1150 Wien
Bereich: IT-Dienstleistungen
UID: ATU72994405
FN: 483557p
FB-Gericht: Wien
E-Mail: office@fenion.at

SOCIAL MEDIA

Besuchen Sie uns auch auf unseren Social Media Kanälen und wir halten Sie über die neuesten Trends und Entwicklungen der Industrie auf dem Laufenden.

