

InstitutionalOpti-Cash M

Risk-Report (MaRisk- und historische Stresstests)

Stand: 29.10.2010

Fondsart: Geldmarktfonds

ISIN: LU0274789303

Anteilspreis [EUR]: 108,57

Auflegungsdatum: 01.12.2006

WPKN: AOLEDA

Fondsstruktur **	% FV	FV [EUR]	DGRV * - Standard Szenarien						DGRV * - Stress Szenarien							
			Zinsänderung		Drehung kurzes Zinsende				Zinsänderung				Drehung kurzes Zinsende			
			+57bp	-57bp	steigend		fallend		+73bp	-98bp	+304bp	-425bp	steigend		fallend	
			1 Tag	1 Tag	1 Tag	250 Tage	1 Tag	250 Tage	1 Tag	1 Tag	250 Tage	250 Tage	1 Tag	250 Tage	1 Tag	250 Tage
Aktienorientierte Anlagen	80,98	153 802 146	-0,04	0,04	-0,03	-0,03	0,02	0,06	-0,05	0,06	-0,21	0,06	-0,08	-0,18	0,05	0,06
Rentenorientierte Anlagen	2,76	5 247 715	-0,00	0,00	-0,00	-0,00	0,00	0,01	-0,00	0,00	-0,01	0,01	-0,00	-0,01	0,00	0,01
Liquidität	16,26	30 887 314	-0,01	0,01	-0,01	-0,01	0,01	0,02	-0,01	0,02	-0,06	0,02	-0,02	-0,05	0,01	0,02
Fonds	100,00	189 937 175	-0,05	0,05	-0,04	-0,04	0,03	0,09	-0,07	0,08	-0,28	0,09	-0,11	-0,24	0,07	0,09

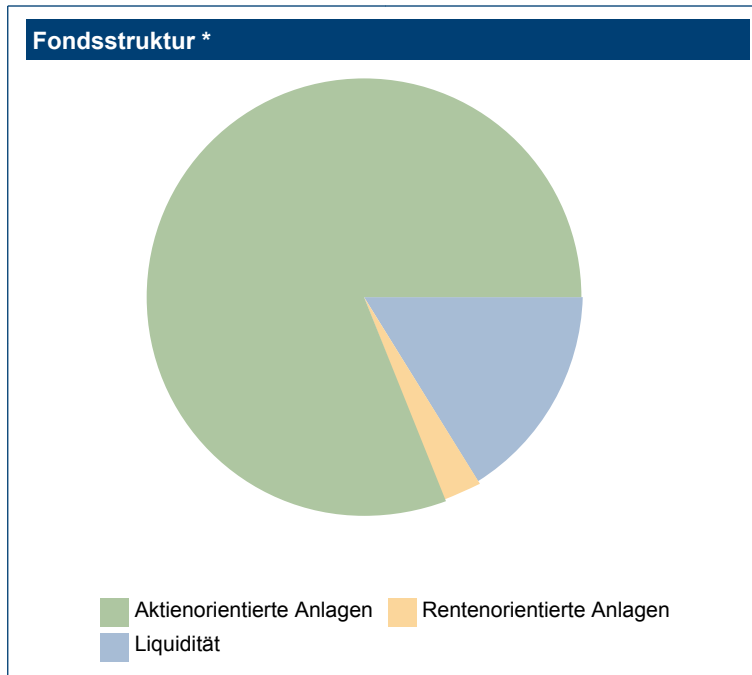
Fondsstruktur **	% FV	FV [EUR]	BaFin/Basel II *		Sonstige *		Historische Szenarien *		
			Zinsänderung		Kreditspreads		Oktober (1987)	Russland (1998)	9/11 (2001)
			+130 bp	-190 bp	-50%	+100%			
Aktienorientierte Anlagen	80,98	153 802 146	-0,09	0,06	0,00	0,00	-0,02	-0,02	-0,03
Rentenorientierte Anlagen	2,76	5 247 715	-0,01	0,01	0,00	-0,01	0,00	0,00	0,00
Liquidität	16,26	30 887 314	-0,03	0,02	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00
Fonds	100,00	189 937 175	-0,12	0,09	0,00	-0,01	-0,01	-0,01	-0,02

* in Prozent des Fondsvermögens, ** inkl. Zielfondsauflösung

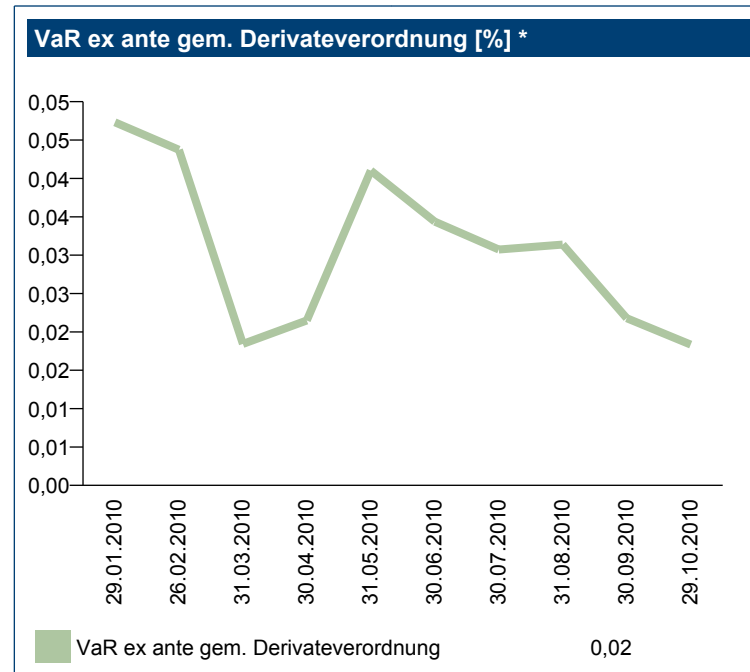
InstitutionalOpti-Cash M

Risk-Report (MaRisk- und historische Stresstests)

Stand: 29.10.2010



* inkl. Zielfondsauflösung



* Konfidenzniveau 99%, Haltedauer 10 Tage.