

# InstitutionalBalance-Plus

## Risk-Report (MaRisk- und historische Stresstests)

Stand: 30.09.2010

Fondsart: Wertgesicherte Fonds

ISIN: DE0008007550

Anteilspreis [EUR]: 53,26

Auflegungsdatum: 01.11.2002

WPKN: 800755

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			
Rentenorientierte Anlagen	81,76	586 605 113	-0,50	0,51	-0,29	-0,29	0,21	1,09	-0,64	0,87	-2,61	1,50	-0,71	-1,57	0,44	1,24
Zinsfutures	0,03	248 262	0,21	-0,22	0,04	0,04	-0,03	-0,15	0,27	-0,36	1,09	-0,46	0,11	0,24	-0,07	-0,16
Liquidität	18,20	130 580 276	-0,04	0,04	-0,03	-0,03	0,02	0,06	-0,05	0,06	-0,20	0,06	-0,07	-0,15	0,04	0,06
<b>Fonds</b>	<b>100,00</b>	<b>717 433 650</b>	<b>-0,33</b>	<b>0,33</b>	<b>-0,27</b>	<b>-0,27</b>	<b>0,20</b>	<b>1,00</b>	<b>-0,42</b>	<b>0,58</b>	<b>-1,72</b>	<b>1,10</b>	<b>-0,67</b>	<b>-1,48</b>	<b>0,42</b>	<b>1,14</b>

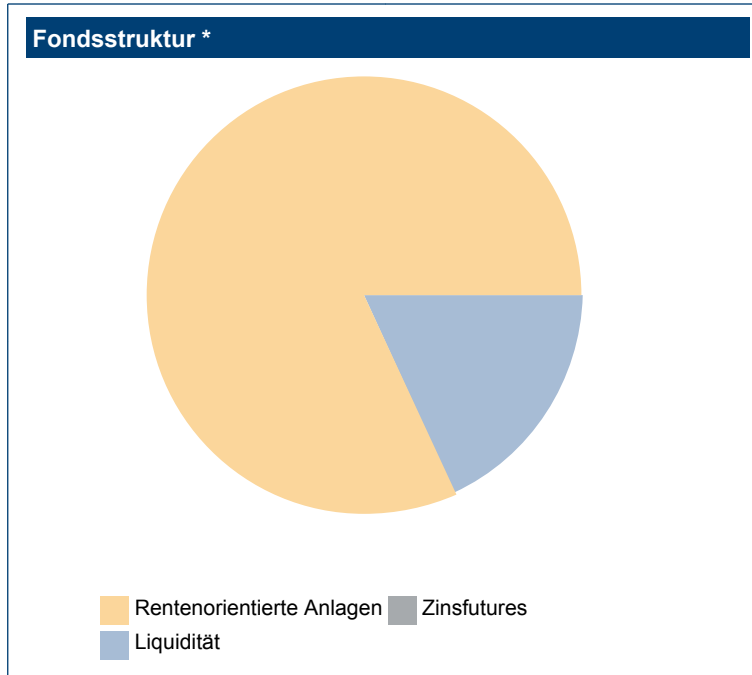
Fondsstruktur **	% FV	FV [EUR]	BaFin/Basel II *		Sonstige *		Historische Szenarien *		
			Zinsänderung		Kreditspreads		Oktober (1987)	Rusland (1998)	9/11 (2001)
			+130 bp	-190 bp	-50%	+100%			
Rentenorientierte Anlagen	81,76	586 605 113	-1,14	1,29	0,43	-0,82	0,28	0,12	0,10
Zinsfutures	0,03	248 262	0,48	-0,46	0,00	0,00	-0,12	-0,05	-0,04
Liquidität	18,20	130 580 276	-0,08	0,06	0,00	0,00	0,02	0,01	0,01
<b>Fonds</b>	<b>100,00</b>	<b>717 433 650</b>	<b>-0,74</b>	<b>0,89</b>	<b>0,43</b>	<b>-0,82</b>	<b>0,18</b>	<b>0,08</b>	<b>0,06</b>

\* in Prozent des Fondsvermögens, \*\* inkl. Zielfondsauflösung

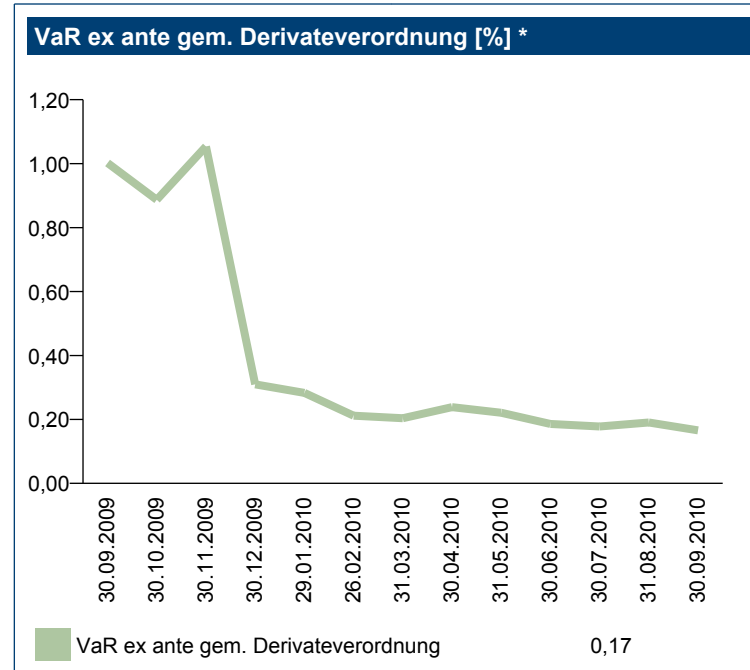
# InstitutionalBalance-Plus

## Risk-Report (MaRisk- und historische Stresstests)

Stand: 30.09.2010



\* inkl. Zielfondsauflösung



\* Konfidenzniveau 99%, Haltedauer 10 Tage.