

InstitutionalOpti-Cash M

Risk-Report (MaRisk- und historische Stresstests)

Stand: 30.06.2010

Fondsart: Geldmarktfonds

ISIN: LU0274789303

Anteilspreis [EUR]: 108,44

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 1 Tag	-57bp 1 Tag	steigend		fallend		+73bp 1 Tag	-98bp 1 Tag	+304bp 250 Tage	-425bp 250 Tage	steigend		fallend	
Aktienorientierte Anlagen	84,08	264 292 446	-0,05	0,04	-0,04	-0,04	0,03	0,05	-0,06	0,05	-0,25	0,05	-0,09	-0,21	0,05	0,05
Rentenorientierte Anlagen	1,00	3 153 869	-0,00	0,00	-0,00	-0,00	0,00	0,00	-0,00	0,00	-0,01	0,00	-0,00	-0,01	0,00	0,00
Liquidität	14,91	46 873 227	-0,00	0,00	-0,00	-0,00	0,00	0,00	-0,00	0,00	-0,01	0,00	-0,01	-0,01	0,00	0,00
Fonds	100,00	314 319 542	-0,05	0,04	-0,04	-0,04	0,03	0,05	-0,07	0,05	-0,27	0,05	-0,10	-0,22	0,05	0,05

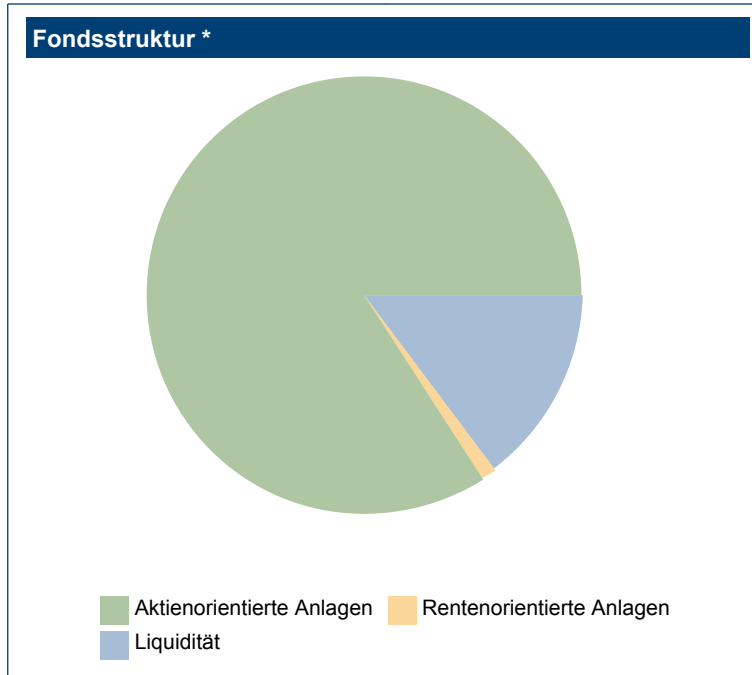
Fondsstruktur **	% FV	FV [EUR]	BaFin/Basel II *		Sonstige *		Historische Szenarien *		
			Zinsänderung		Kreditspreads		Oktober (1987)	Rusland (1998)	9/11 (2001)
			+130 bp	-190 bp	-50%	+100%			
Aktienorientierte Anlagen	84,08	264 292 446	-0,11	0,05	0,00	0,00	-0,02	-0,02	-0,03
Rentenorientierte Anlagen	1,00	3 153 869	-0,00	0,00	0,00	-0,00	0,00	0,00	0,00
Liquidität	14,91	46 873 227	-0,01	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Fonds	100,00	314 319 542	-0,12	0,05	0,00	-0,00	-0,02	-0,02	-0,03

* in Prozent des Fondsvermögens, ** inkl. Zielfondsauflösung

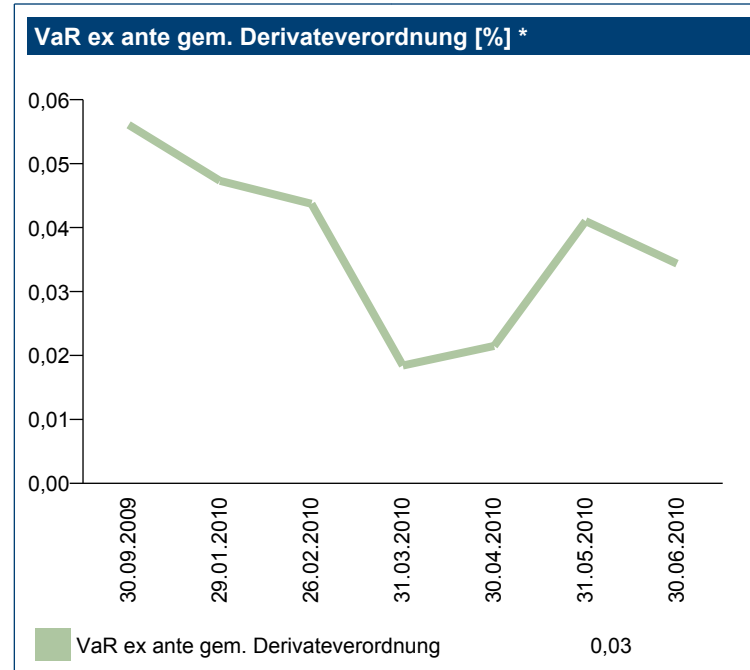
InstitutionalOpti-Cash M

Risk-Report (MaRisk- und historische Stresstests)

Stand: 30.06.2010



* inkl. Zielfondsauflösung



* Konfidenzniveau 99%, Haltedauer 10 Tage.