

# InstitutionalBalance-Plus

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

Stand: 29.10.2010

Fondsart: Wertgesicherte Fonds

ISIN: DE0008007550

Anteilspreis [EUR]: 53,32

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 | 79,17         | 550 610 948        | -0,41                       | 0,42        | -0,25                   | -0,25        | 0,18        | 0,99        | -0,53                     | 0,72        | -2,15        | 1,27        | -0,62                   | -1,37        | 0,38        | 1,11        |
| Zinsfutures               | 0,10          | 703 832            | 0,22                        | -0,22       | 0,05                    | 0,05         | -0,04       | -0,20       | 0,28                      | -0,39       | 1,11         | -0,57       | 0,13                    | 0,28         | -0,08       | -0,21       |
| Liquidität                | 20,73         | 144 177 116        | -0,03                       | 0,03        | -0,02                   | -0,02        | 0,02        | 0,06        | -0,04                     | 0,05        | -0,16        | 0,06        | -0,06                   | -0,13        | 0,04        | 0,06        |
| <b>Fonds</b>              | <b>100,00</b> | <b>695 491 896</b> | <b>-0,23</b>                | <b>0,23</b> | <b>-0,22</b>            | <b>-0,22</b> | <b>0,16</b> | <b>0,85</b> | <b>-0,29</b>              | <b>0,39</b> | <b>-1,20</b> | <b>0,77</b> | <b>-0,55</b>            | <b>-1,21</b> | <b>0,34</b> | <b>0,96</b> |

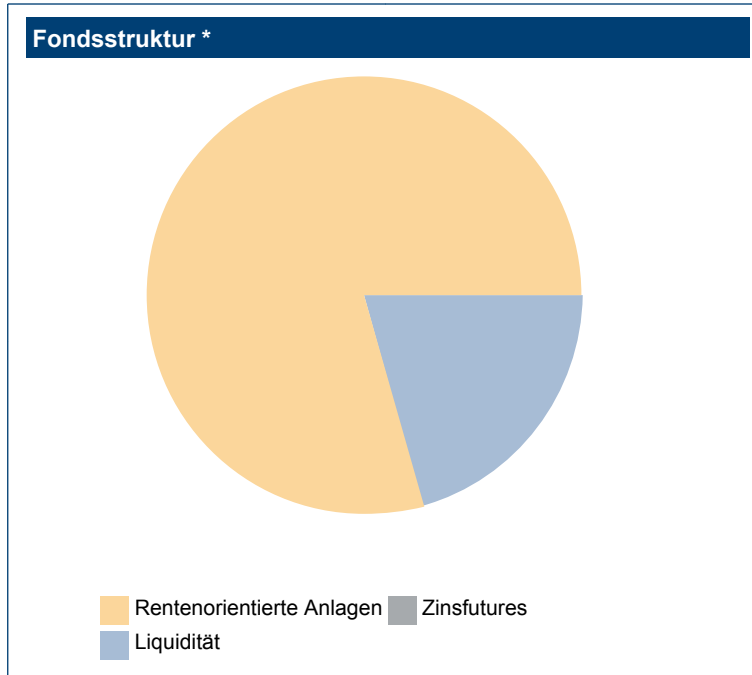
| Fondsstruktur **          | % FV          | FV [EUR]           | BaFin/Basel II * |             | Sonstige *    |              | Historische Szenarien * |                 |             |
|---------------------------|---------------|--------------------|------------------|-------------|---------------|--------------|-------------------------|-----------------|-------------|
|                           |               |                    | Zinsänderung     |             | Kreditspreads |              | Oktober (1987)          | Russland (1998) | 9/11 (2001) |
|                           |               |                    | +130 bp          | -190 bp     | -50%          | +100%        |                         |                 |             |
| Rentenorientierte Anlagen | 79,17         | 550 610 948        | -0,94            | 1,12        | 0,29          | -0,57        | 0,23                    | 0,10            | 0,08        |
| Zinsfutures               | 0,10          | 703 832            | 0,49             | -0,57       | 0,00          | 0,00         | -0,12                   | -0,05           | -0,04       |
| Liquidität                | 20,73         | 144 177 116        | -0,07            | 0,06        | 0,00          | 0,00         | 0,02                    | 0,01            | 0,01        |
| <b>Fonds</b>              | <b>100,00</b> | <b>695 491 896</b> | <b>-0,52</b>     | <b>0,61</b> | <b>0,29</b>   | <b>-0,57</b> | <b>0,12</b>             | <b>0,06</b>     | <b>0,04</b> |

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

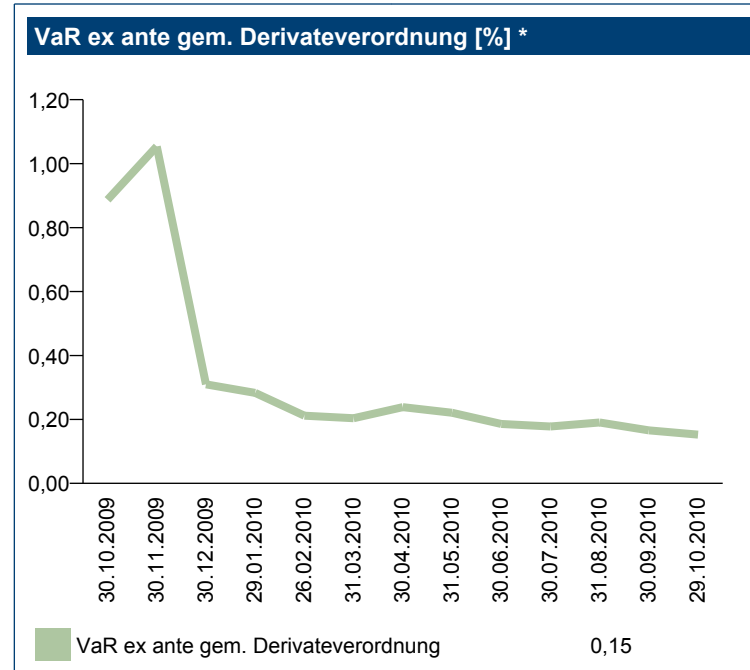
# InstitutionalBalance-Plus

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

Stand: 29.10.2010



\* inkl. Zielfondsauflösung



\* Konfidenzniveau 99%, Haltedauer 10 Tage.