

InstitutionalOpti-Cash M

Risk-Report (MaRisk- und historische Stresstests)

Stand: 30.09.2010

Fondsart: Geldmarktfonds
Auflegungsdatum: 01.12.2006

ISIN: LU0274789303
WPKN: A0LEDA

Anteilspreis [EUR]: 108,54

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	78,07	175 606 110	-0,04	0,03	-0,03	-0,03	0,02	0,04	-0,05	0,04	-0,20	0,04	-0,08	-0,17	0,04	0,04
Rentenorientierte Anlagen	8,41	18 908 207	-0,01	0,01	-0,01	-0,01	0,00	0,02	-0,01	0,01	-0,05	0,02	-0,02	-0,04	0,01	0,02
Liquidität	13,52	30 414 875	-0,01	0,01	-0,01	-0,01	0,01	0,02	-0,02	0,02	-0,08	0,02	-0,03	-0,06	0,02	0,02
Fonds	100,00	224 929 192	-0,06	0,06	-0,05	-0,05	0,04	0,08	-0,08	0,08	-0,32	0,08	-0,12	-0,27	0,07	0,08

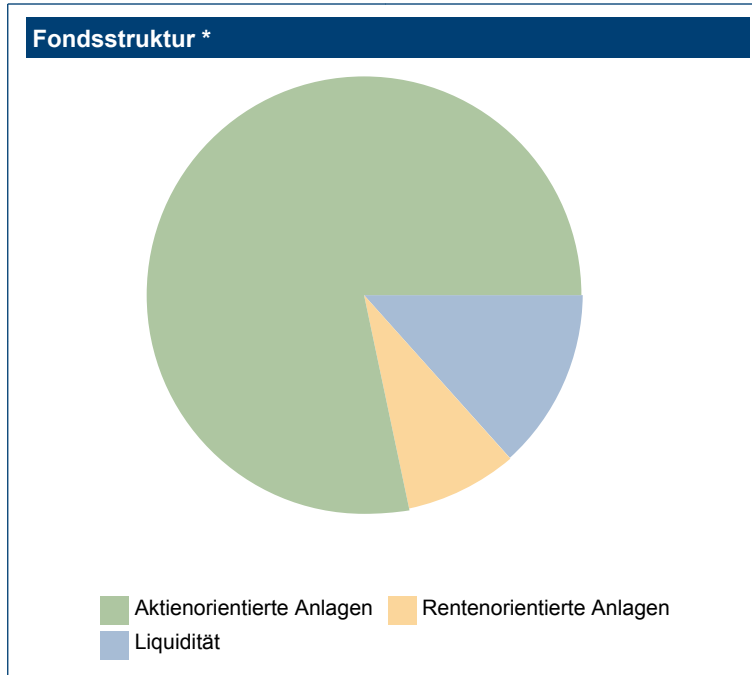
Fondsstruktur **	% FV	FV [EUR]	BaFin/Basel II *		Sonstige *		Historische Szenarien *		
			Zinsänderung		Kreditspreads		Oktober (1987)	Rusland (1998)	9/11 (2001)
			+130 bp	-190 bp	-50%	+100%			
Aktienorientierte Anlagen	78,07	175 606 110	-0,09	0,04	0,00	0,00	-0,02	-0,02	-0,03
Rentenorientierte Anlagen	8,41	18 908 207	-0,02	0,02	0,01	-0,02	0,00	0,00	0,00
Liquidität	13,52	30 414 875	-0,03	0,02	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00
Fonds	100,00	224 929 192	-0,14	0,08	0,01	-0,02	-0,01	-0,01	-0,03

* in Prozent des Fondsvermögens, ** inkl. Zielfondsauflösung

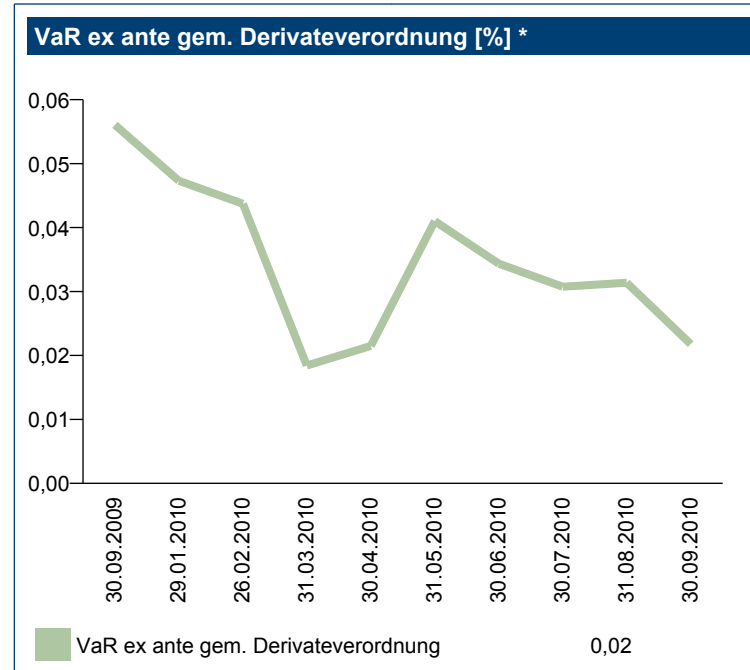
InstitutionalOpti-Cash M

Risk-Report (MaRisk- und historische Stresstests)

Stand: 30.09.2010



* inkl. Zielfondsauflösung



* Konfidenzniveau 99%, Haltedauer 10 Tage.