

# InstitutionalBalance-Plus

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

Stand: 30.06.2010

Fondsart: Wertgesicherte Fonds  
Auflegungsdatum: 01.11.2002

ISIN: DE0008007550  
WPKN: 800755

Anteilpreis [EUR]: 53,10

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	
Rentenorientierte Anlagen	85,80	641 463 536	-0,66	0,67	-0,33	-0,33	0,24	1,24	-0,85	1,14	-3,41	2,09	-0,80	-1,77	0,50	1,48
Zinsfutures	-0,04	- 321 808	0,22	-0,23	0,05	0,05	-0,03	-0,15	0,29	-0,37	1,15	-0,55	0,12	0,26	-0,07	-0,15
Liquidität	14,25	106 507 263	-0,04	0,04	-0,03	-0,03	0,02	0,05	-0,05	0,05	-0,19	0,05	-0,07	-0,15	0,04	0,05
<b>Fonds</b>	<b>100,00</b>	<b>747 648 991</b>	<b>-0,48</b>	<b>0,48</b>	<b>-0,31</b>	<b>-0,31</b>	<b>0,22</b>	<b>1,14</b>	<b>-0,61</b>	<b>0,82</b>	<b>-2,45</b>	<b>1,59</b>	<b>-0,75</b>	<b>-1,66</b>	<b>0,46</b>	<b>1,38</b>

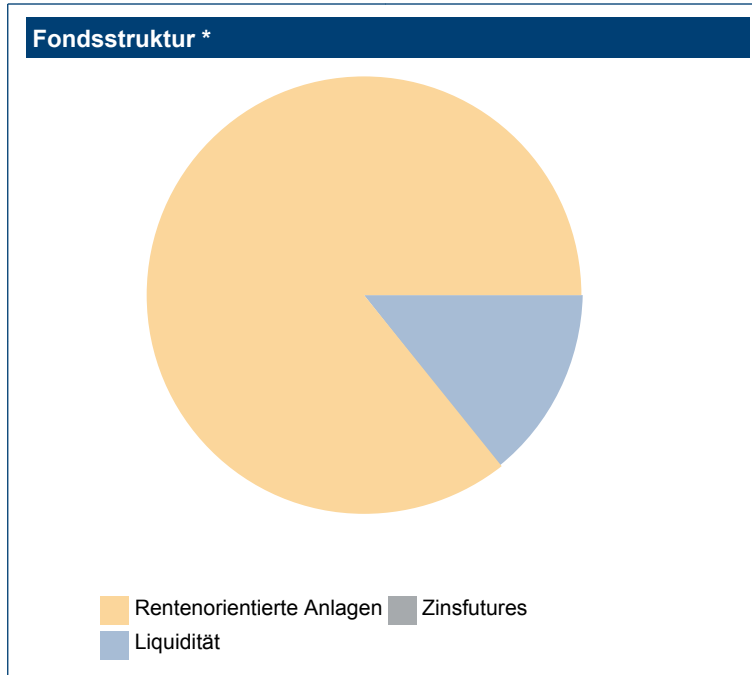
Fondsstruktur **	% FV	FV [EUR]	BaFin/Basel II *		Sonstige *		Historische Szenarien *		
			Zinsänderung		Kreditspreads		Oktober (1987)	Rusland (1998)	9/11 (2001)
			+130 bp	-190 bp	-50%	+100%			
Rentenorientierte Anlagen	85,80	641 463 536	-1,50	1,86	0,52	-1,01	0,37	0,16	0,13
Zinsfutures	-0,04	- 321 808	0,50	-0,55	0,00	0,00	-0,12	-0,06	-0,04
Liquidität	14,25	106 507 263	-0,08	0,05	0,00	0,00	0,02	0,01	0,01
<b>Fonds</b>	<b>100,00</b>	<b>747 648 991</b>	<b>-1,08</b>	<b>1,36</b>	<b>0,52</b>	<b>-1,01</b>	<b>0,26</b>	<b>0,12</b>	<b>0,09</b>

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

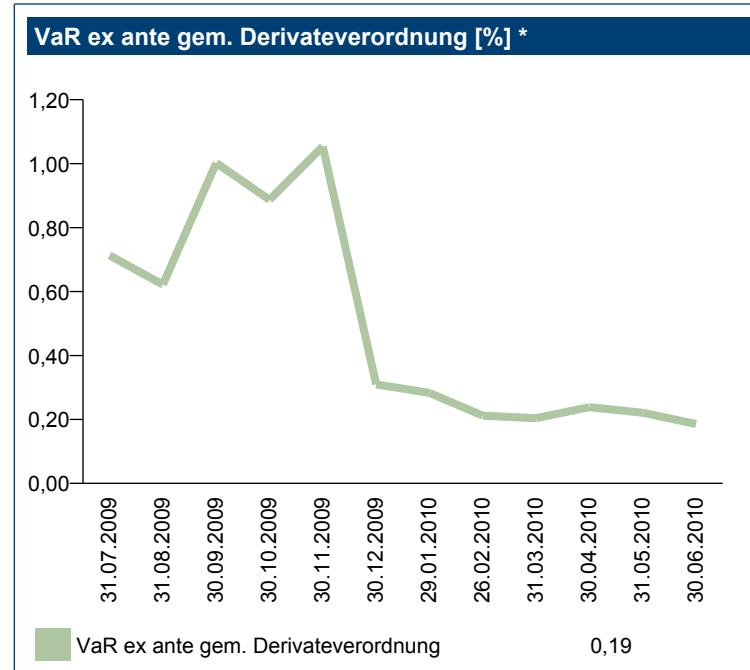
# InstitutionalBalance-Plus

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

Stand: 30.06.2010



\* inkl. Zielfondsauflösung



\* Konfidenzniveau 99%, Haltedauer 10 Tage.