

VaR - Report 10.02.2012

Musterfonds

Name						
Musterfonds						
Volumen		(in Mio. Euro)	40,677	Abw. des Marktwerts:		0,06%
Datum		10.02.2012		09.02.2012		
	in Mio. EUR	in % des NAV	in Mio. EUR	in % des NAV	Veränderung	
VaR	0,452	1,1%	0,447	1,1%	1,1%	
Linearer VaR	0,452	1,1%	0,447	1,1%	1,1%	
VaR Aktien	0,164	0,4%	0,165	0,4%	-0,6%	
VaR Zins	0,453	1,1%	0,448	1,1%	1,1%	
VaR Devisen	0,049	0,1%	0,049	0,1%	0,0%	
Korrelationseffekt	-0,214	-0,5%	-0,214	-0,5%	0,0%	
Nicht-linearer VaR	0,000	0,0%	0,000	0,0%		
Stresswert	3,036	(7,5%)	3,038	(7,5%)	-(0,1%)	
Stresswert Aktien	1,585	(3,9%)	1,588	(3,9%)	-(0,2%)	
Stresswert Zins	1,327	(3,3%)	1,327	(3,3%)	(0,0%)	
Stresswert Devisen	0,124	(0,3%)	0,124	(0,3%)	(0,0%)	
Historische Szenarien		10.02.2012		09.02.2012		Veränderung
Crash 1987	0,450	(1,1%)	0,451	(1,1%)	-(0,2%)	
Crash 09/11	0,300	(0,7%)	0,301	(0,7%)	-(0,3%)	
EWR-Krise	1,607	(4,0%)	1,606	(3,9%)	(0,1%)	
Russland-Krise	0,000	(0,0%)	0,000	(0,0%)		
Finanzmarktkrise						

Name						
Vergleichsvermögen Musterfonds						
		100,0%	IBOXX Euro Corporate			
Datum		10.02.2012		09.02.2012		
	in Mio. EUR	in % des NAV	in Mio. EUR	in % des NAV	Veränderung	
VaR	0,691	1,7%	0,690	1,7%	0,1%	
Korrelationseffekt	0,000	0,0%	0,000	0,0%		

