

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%)

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%
Linearer VaR	0,691	1,7%	0,690	1,7%	0,1%
VaR Aktien	0,000	0,0%	0,000	0,0%	
VaR Zins	0,691	1,7%	0,690	1,7%	0,1%
VaR Devisen	0,000	0,0%	0,000	0,0%	
Korrelationseffekt	0,000	0,0%	0,000	0,0%	
Nicht-linearer VaR	0,000	0,0%	0,000	0,0%	
Stresswert					
	1,182	(2,9%)	1,181	(2,9%)	(0,1%)
Stresswert Aktien	0,000	(0,0%)	0,000	(0,0%)	
Stresswert Zins	1,182	(2,9%)	1,181	(2,9%)	(0,1%)
Stresswert Devisen	0,000	(0,0%)	0,000	(0,0%)	

