

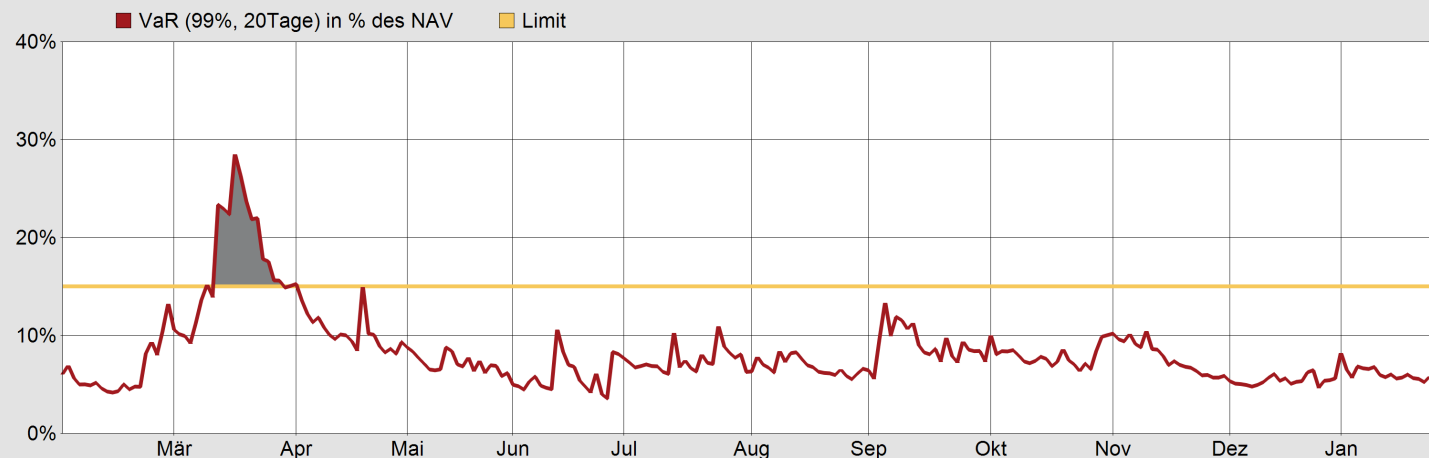
Risiko-Kontrollstatus



Methode & Limitierung

Reportingwährung	EUR
VaR-Methode	Varianz-Kovarianz
VaR-Horizont	20 Tage
Limit-Methode	Absolut
Limit	15,00%
Absolute Auslastung	8,72%
Limitauslastung	58,15%

Value-at-Risk Limit-Auslastung



Zusammenfassung der Kennzahlen zur Beurteilung des Marktpreisrisikos

Kennzahlen	Referenzdatum 29.01.2021	Delta zum Vortag 28.01.2021	VaR 20T(99%) Max 12M 17.03.2020	Referenz-Portfolio
NAV in EUR	23.580.641	-360.560	19.091.946	
VaR 1T 99% in EUR	459.945	138.015	1.216.637	602.743
VaR 1T 99% in %	1,95%	0,61%	6,37%	2,56%
VaR 20T 99% in EUR	2.056.935	617.223	5.440.966	2.695.550
VaR 20T 99% in %	8,72%	2,71%	28,50%	11,43%
Relative Auslastung	76,31%	-15,13%		
Clean P&L	n.a.	n.a.		
Backtesting	n.a.	n.a.		
NPV nach Stress *	21.801.177	22.334		
NPV-Veränderung nach Stress (%) *	-8,94%	0,00%		

* per 28.01.2021

Referenzportfolio

Index	Gewichtung
iBoxx € Overall	25,00%
MSCI EUROPE INDEX	75,00%

Die 10 Positionen mit dem höchsten VaR-Beitrag (Component-VaR)

Kennung	Beschreibung	Whg	Marktbewertung(EUR)	VaR 99% 20T	VaR-Beitrag
US0378331005	APPLE INC	USD	3.993.348	1.393.922	812.775
US5949181045	MICROSOFT CORP	USD	3.617.216	672.206	389.024
NL0000009538	KONINKLIJKE PHILIPS NV	EUR	899.100	150.760	68.832
DE0008430026	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	EUR	770.000	111.074	60.315
DE0007100000	DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	EUR	581.100	115.813	54.445
DE000TR8LBA5	HSBC TRINKAUS+BURKHARDT - CAPPED BONUS	EUR	429.250	72.213	43.259
DE000BASF111	BASF SE	EUR	573.300	85.121	40.608
HU0000061726	OTP BANK PLC	HUF	755.460	95.714	36.919
LU0107944042	LOYS SICAV - LOYS GLOBAL	EUR	661.508	55.892	29.850
DE000CBK1001	COMMERZBANK AG	EUR	219.360	62.730	25.513

Limitüberschreitungen (15 in den letzten 250 Tagen)

Ref. Datum	Auslastung	Ref. Datum	Auslastung
01.04.2020	101,60%	17.03.2020	189,99%
31.03.2020	100,28%	16.03.2020	149,03%
27.03.2020	103,91%	13.03.2020	152,68%
26.03.2020	104,05%	12.03.2020	155,49%
25.03.2020	117,00%	10.03.2020	101,09%
24.03.2020	118,62%		
23.03.2020	146,41%		
20.03.2020	145,65%		
19.03.2020	158,20%		
18.03.2020	175,29%		