

Inhalt

1. **Überblick**
2. **Grundsätzliches zum gewählten Vorgehen**
3. **Ermittlung der Risiken aus den Fondspositionen im Standardrisikofall**
 - 3.1 Ermittlung des Zinsspannenrisikos
 - 3.2 Ermittlung der (sonstigen) Marktpreisrisiken
 - 3.3 Ermittlung der Adressenrisiken
4. **Ermittlung der Risiken aus den Fondspositionen im Stressfall**
 - 4.1 Ermittlung des Zinsspannenrisikos
 - 4.2 Ermittlung der (sonstigen) Marktpreisrisiken
 - 4.3 Ermittlung der Adressenrisiken
5. **Ermittlung der Auswirkungen eines schweren konjunkturellen Abschwungs**
6. **Inverser Stresstest unter Einbeziehung der Fondspositionen**
 - 6.1 Inverser Stresstest für Marktpreisrisiken
 - 6.2 Inverser Stresstest für Adressenrisiken
7. **Diversifikationseffekte bei der Messung der Fondsrisiken**
8. **Frühwarnindikatoren für Fondsrisiken**
9. **Ermittlung von Risikokonzentrationen unter Einbeziehung der Fondspositionen**
10. **Risikobericht zu den Fondsrisiken**
11. **Wesentliche Informationen zu den Fondsrisiken (Ad-hoc-Berichterstattung)**
12. **Überprüfung der Angemessenheit der zur Risikoermittlung der Fondspositionen genutzten Methoden und Verfahren**

Stand: 31.08.2015 – Version 1.0.0

Version	Veränderung
1.0.0	Erstausgabe

Stand: 31.08.2015 – Version 1.0.0