

Prototype Report (Deutsch)

Fondsname	Fonds Nr. 366
Fondsnummer	44
Asset Manager	Deutsche Asset Management Investmentgesellschaft mbH
KAG	BayernLB HEDGE FONDS SICAV
Depot Bank	Banque Populaire Du Luxembourg
Fondsart	Klassischer Spezialfonds
Juristischer Fonds?	
Dachfonds	HPX Master 33
Produktklasse	Nitro.Entities.ProductClass
Gesetzliche Grundlage	InvG 2007 - Richtlinien-konformes Sondervermögen
Risikoansatz	DE - Derivate Verordnung (DerivateV) - Einfacher Ansatz
Anlagekonzept	Pfandbriefe buy + hold.
Anlagegrenzen	Berechnung aller Grenzen auf Marktwerten bzw. Buchwerten.
Anlagegrenze Bemerkung	Keine Bemerkung in den Anlagegrenzen.
Gultig ab	09.29.2011
Bemerkungen	Keine Bemerkungen im Fonds.

Währungen	
Basiswährung des Fonds	EUR - Euro
Währungseinschränkungen	keine
Bemerkung	Keine Bemerkungen im Anlageuniversum.

Anlageuniversum	
Anlagen außerhalb des Anlageuniversums	Anlagen außerhalb des Anlageuniversums sind unzulässig.
Nicht notierte Wertpapiere gem. § 52 Abs. 1 InvG sind unzulässig (nicht notierte Wertpapiere).	False
Nicht notierte Wertpapiere gem. § 52 Abs. 2 InvG sind unzulässig (GMI, die nicht § 48 genügen).	True
Nicht notierte Wertpapiere gem. § 52 Abs. 3 InvG sind unzulässig (Aktien gem. § 47 Abs. 1 Nr. 3 und 4).	True
Nicht notierte Wertpapiere gem. § 52 Abs. 4 InvG sind unzulässig (Schuldscheindarlehen).	True
Bemerkung	Keine Bemerkung im Anlageuniversum.
Anlageeinschränkungen	False

Derivate	
Derivate	Cross currency Non-deliverable forwards sind erlaubt.
	Commodity forwards sind erlaubt.
	Foreign exchange dealing sind erlaubt.
	Derivatives sind erlaubt.
	Equity forwards sind erlaubt.
	Cross currency foreign exchange dealing sind erlaubt.
	Non-deliverable forwards (NDFs) sind erlaubt.
	Forwards sind erlaubt.
To be announced (TBAs) sind erlaubt.	
Futures	Gold futures sind erlaubt. Gold futures sind in der folgenden Formen erlaubt:
	Platinum futures sind erlaubt. Platinum futures sind in der folgenden Formen erlaubt:
	Interest rate futures sind erlaubt. Interest rate futures sind nur zur Sicherung erlaubt. Short's sind erlaubt und Long's sind unzulässig.
	Equity futures sind erlaubt. Equity futures sind in der folgenden Formen erlaubt:
	Silver futures sind erlaubt. Silver futures sind in der folgenden Formen erlaubt:
	Futures sind erlaubt. Futures sind in der folgenden Formen erlaubt:
	Commodity futures sind erlaubt. Commodity futures sind in der folgenden Formen erlaubt:
	Volaindex futures sind erlaubt. Volaindex futures sind in der folgenden Formen erlaubt:
Commodity index futures sind erlaubt. Commodity index futures sind in der folgenden Formen erlaubt:	
Annuity futures sind erlaubt. Annuity futures sind nur zur Sicherung erlaubt. Short's sind erlaubt und Long's sind unzulässig.	
Optionen und Optionscheine	Warrants sind erlaubt. Warrants sind in der folgenden Formen erlaubt:
	Commodity futures options sind erlaubt. Commodity futures options sind in der folgenden Formen erlaubt:

Derivate	
Optionen und Optionscheine	Options sind erlaubt. Options sind in der folgenden Formen erlaubt:
	Stock Warrants sind erlaubt. Stock Warrants sind in der folgenden Formen erlaubt:
	Interest rate futures options sind erlaubt. Interest rate futures options sind in der folgenden Formen erlaubt:
	Options and Warrants sind erlaubt. Options and Warrants sind in der folgenden Formen erlaubt:
	Equity options sind erlaubt. Equity options sind in der folgenden Formen erlaubt:
	Foreign exchange options sind erlaubt. Foreign exchange options sind in der folgenden Formen erlaubt:
	Equity index warrants sind erlaubt. Equity index warrants sind in der folgenden Formen erlaubt:
	Annuity options sind erlaubt. Annuity options sind in der folgenden Formen erlaubt:
	Commodity forward options sind erlaubt. Commodity forward options sind in der folgenden Formen erlaubt:
	Equity index options sind erlaubt. Equity index options sind in der folgenden Formen erlaubt:
	Swaptions sind erlaubt. Swaptions sind in der folgenden Formen erlaubt:
	Annuity futures options sind erlaubt. Annuity futures options sind in der folgenden Formen erlaubt:
	Equity index futures options sind erlaubt. Equity index futures options sind in der folgenden Formen erlaubt:
Swaps	iTraxx Europe Crossover sind erlaubt.
	iTraxx Europe sind erlaubt.
	Interest rate swaps sind erlaubt.
	Total return swaps sind erlaubt.
	Credit default swaps sind erlaubt.
	Equity swaps sind erlaubt.
	iTraxx Senior Financials sind erlaubt.
	Swaps sind erlaubt.
	iTraxx Europe HiVol sind erlaubt.
	Equity Index Swaps sind erlaubt.
	Credit default index swaps sind erlaubt.
	iTraxx Sub Financials sind erlaubt.

Wertpapier
Common stock sind erlaubt.
Preference Share sind erlaubt.
Reverse convertible bonds sind erlaubt.
Authority bonds sind mit minimal 34% erlaubt.
Subordinate Financial Bonds sind erlaubt.
Inflationlinked bonds sind erlaubt.
Convertible bonds sind erlaubt.
Treasury bill (2) sind mit minimal 8% erlaubt.
Bonds of regional administrative bodies or regional governments sind erlaubt.
Mortgage certificates sind erlaubt.
Credit linked notes sind erlaubt.
Government bonds sind erlaubt.
Industrial bonds sind erlaubt.
Corporate bonds sind erlaubt.
Financial bonds sind erlaubt.
Structured bonds sind erlaubt.
Senior Financial Bonds sind erlaubt.
Covered bonds sind erlaubt.
Public bonds sind erlaubt.
Bonds of international organisations sind erlaubt.
Bonds of supranatural organisations sind erlaubt.
Federal state bonds sind erlaubt.
Warrant bonds sind erlaubt.
Equity linked notes sind erlaubt.
Government guaranteed bonds sind erlaubt.
Subordinate Industrial Bonds sind erlaubt.
Exchangeable bonds sind erlaubt.
Senior Industrial Bonds sind erlaubt.
Participation rights (annuity-like) sind erlaubt.
Bonds sind erlaubt.
Capital market floater sind erlaubt.

Wertpapier
Public agency bonds sind erlaubt.
Loan participation notes sind erlaubt.
Participation rights (share-like) sind erlaubt.
Participation rights sind erlaubt.
ADRs sind erlaubt.
GDRs sind erlaubt.
EDRs sind erlaubt.
IDRs sind erlaubt.

Wertuntergrenze		
Untergrenze	True	Die Wertuntergrenze pro Kalendjahresresultimo beträgt 78,00 EUR. Diskussionen zwecklos.

Benchmarks		
Bemerkung	Weitere Vorgaben Benchmark.	
	Indextyp	Index
		Gewicht (%)
Vergleichsindex	Dow Jones Industrial Average (Pr.)	56
	EURO STOXX (Price, EUR)	44
Alternative Benchmark	FTSE 250	108
	STOXX 50 (Price, EUR)	-8

Länderrestriktionen			
Ländereinschränkungen			
Einzel- und Gruppenauswahl			
Bemerkung	Keine Bemerkung in den Ländern.		
Allokationen	Land	Min (%)	Max (%)
Erlaubt	G8 Countries	34	0
Verboten	Euro Area	0	0
	Russia	0	0

Börsen			
Börseneinschränkungen			
Bemerkung			
Allokationen	Börse	Min (%)	Max (%)
Erlaubt	STANDARD EXCHANGES	0	0

Rating	
Ratingvorgaben	False
Standard & Poor's	True
Fitch	True
Moody's	True
Andere Ratingagentur	True K36
Emissions- / Emittentenrating	Relevanz hat nur das Emittentenrating
Regelung zu Splitratings	Im Falle eines Splitratings ist das bessere Rating ausschlaggebend.
Non-Rated-Anleihen	Anleihen und Geldmarktinstrumente ohne Ratings sind unzulässig.
Durchschnittsrating	Das Durchschnittsrating des Fonds muß mind. BBB betragen.
Mindestrating auf Einzeltitelebene	
Ratingverschlechterung	
Zusätzliche Vorgaben	Keine Bemerkungen im Rating.

Einzelemittentenbeschränkungen			
Einzelemittentenbeschränkungen	False		
Bemerkung	Keine Bemerkung in den Einzelemittentenbeschränkungen.		
	Fondsvermögen (%)	Fondsvermögen Mio. (Fondswährung)	
Staatsemittent	1	2	
Pfandbriefemittent	3	4	
Emittent	5	6	
Konzern	7	8	
Allokationen	Emittent	Min (%)	Max (%)
Verboten	Siemens AG (Konzern)	0	0
	Siemens AG	0	0

Weitere Einschränkungen		
Weitere Einschränkungen	False	
Maximale Anleihedauer in Jahren	True	12
Maximale Anleihen-Restlaufzeit in Jahren	True	15
Max. x % des stimmberechtigten Kapitals (Stimmrechte) eines Unternehmens	True	18
Maximale Fonds-Restlaufzeit in Jahren	True	14
Max % Fondsvermögen für andere Investments	True	1
Abs. Mio. Fondsvermögen für andere Investments	True	2
Die Duration des Fonds (inkl. Kasse) darf maximal x Jahre betragen	True	10
Max. % des Fondsvermögens je Emittent in anderen Investments	True	3
Abs. Mio. des Fondsvermögens je Emittent in anderen Investments	True	4
Max. % des Fondsvermögens in anrechnungspflichtigen Investments je Kreditnehmereinheit	True	5
Abs. Mio. des Fondsvermögens in anrechnungspflichtigen Investments je Kreditnehmereinheit	True	6
Minimum Emissionsvolumen je Anleihe in Mio. Fondswährung	True	7
Minimum Marktkapitalisierung je Aktie in Mio. Fondswährung	True	8
Maximum Marktkapitalisierung je Aktie in Mio. Fondswährung	True	9
Die mod. Duration je Anleihe darf maximal x Jahre betragen	True	13
Die mod. Duration des Fonds (inkl. Kasse) darf maximal x Jahre betragen	True	11
Der Tracking Error Ex-Ante soll bezogen auf das gesamte Fondsvermögen nicht mehr als x % p.a. betragen	True	17
Der Tracking Error Ex-Post soll bezogen auf das gesamte Fondsvermögen nicht mehr als x % p.a. betragen	True	16
Bemerkung	Keine Bemerkung in den weiteren Restriktionen.	

Kasse		
Kreditaufnahme	Eine Kreditaufnahme ist bis max. 12 % des Fondsvolumens erlaubt.	
Liquidität ist unter Beachtung der Kombinationsgrenze gem. §60 InvG auf Ebene des Segmentfondsvermögens zulässig	True	
Die Cashquote darf max. x Mio € betragen		
Die Cashquote darf max. x % des Fondsvolumens betragen	False	
Bemerkung	Keine weiteren Bemerkungen in der Kasse.	

Branchen			
Es gibt keine Branchenvorgaben.	False		
Bemerkung			
Allocation			
	Branch	Min	Max
Verboten	Financial	0	0
	Banken	0	0
	Diverse Finanzdienste	0	0
	Haushaltsartikel & Körperpflegeprodukte	0	0
Erlaubt	Industrials	0	0
	Immobilien	0	0
	Versicherungen	0	0
	Energie	0	0
	Automobile & Komponenten	0	0

Management-Gebühren	
Mindestgebühr p.a. (Vertragswährung)	78000
Obergrenze p.a. (% Fondsvermögen)	1.58
Zahlungsweise Basisvergütung	
Feste Basisvergütung in % des Fondsvermögens p.a.	1.23
Feste Basisvergütung in Vertragswährung p.a.	52000
Gewinnbeteiligung bei Outperformance	14
Reduktion der Basisvergütung bei Underperformance in %	50
Zahlungsweise EaV	monatlich
Start der Vergleichsperiode	01.01.0001
High-Water Mark (Vertragswährung)	89.5
Zusätzliche Vorgaben	Abweichende Vereinbarungen bedürfen der Schriftform.

Drittbank-Gebühren	
Währungshandel	12
Futures	120
Geldtransaktionen	150
Optionen	78
OTC-Optionen	104
Wertpapiergeschäfte	45
Swaps	178
Wertpapierdarlehen	267

Depotbank-Gebühren	
Mindestgebühr p.a. (Vertragswährung)	23000
Obergrenze p.a. (% Fondsvermögen)	0.0035
Feste Vergütung in % des Fondsvermögens p.a.	0.0028
Feste Vergütung in Vertragswährung des Fondsvermögens p.a.	21000
Zahlungsweise	
Bemerkung	Weitere Leistungen gem. schriftlicher Vereinbarung.

Verwaltungs-Gebühren	
Mindestgebühr p.a. (Vertragswährung)	0
Obergrenze p.a. (% Fondsvermögen)	0
Feste Vergütung in % des Fondsvermögens p.a.	0
Feste Vergütung in Vertragswährung des Fondsvermögens p.a.	0
Zahlungsweise	
Bemerkung	

Stammdaten	
WKN	343270
ISIN	DE0034327092
SAP-Nr.	
Interne Fonds Nr.	10001
Externe Fonds Nr.	70007
Externes Fondsrating	S&P: AAA
Max. Ausgabeaufschlag (%)	3.7
Tatsächlicher Ausgabeaufschlag (%)	2.9
Max. Rücknahmeabschlag (%)	0.34
Tatsächlicher Rücknahmeabschlag (%)	0.12
Empfänger Rücknahmeabschlag	n.a.
Mindestanlagesumme (Vertragswrg.)	200
Beginn des Geschäftsjahres	01.April
Ertragsverwendung	Thesaurierend
Kommentar zu Ertragsverwendung	
Bilanzielle Auflösung am	12.31.2013
Offizielle Auflösung am	12.11.2013

Fondsaufgabe	
Auflegungstermin	12.01.2010
Ende 1. Geschäftsjahr	12.31.2011
Zeichnungsfrist Beginn	11.01.2010
Zeichnungsfrist Ende	11.28.2010
Erster Ausgabepreis (Fondswährung)	54.33
Erster Rücknahmepreis (Fondswährung)	53.68
Startdotations (Fondswährung)	50000000
Sponsor	Pensionsverein "Frankfurter Kranz e.V." im Wäldchen.
Genehmigendes Amt	BAFin
Datum Genehmigung Amt	10.13.2010
Beschluss auflegende KAG am	08.27.2010

Wertpapierdarlehen (-leihe) / Wertpapierpensionsgeschäfte	
Wertpapierdarlehen (-leihe)	Wertpapierdarlehen sind unzulässig.
Wertpapierpensionsgeschäfte	
Bemerkung	