

HI-Balanced 40-Fonds

Helaba Invest

Kapitalanlagegesellschaft mbH
 Junghofstr. 24
 60311 Frankfurt
 Tel. Nr.: 069/29970-0
 Fax Nr.: 069/29970-630
 www.helaba-invest.de

Dezember 2011 (Kursdatum: 30.12.2011, Bewertungsdatum: 02.01.2012)

Anlageziel Anlagepolitik

Das Sondervermögen strebt als Anlageziel ein kontinuierliches Kapitalwachstum durch die Anlage in verzinsliche Wertpapiere und Aktien an. Dabei ist der Anteil der Aktienanlage auf 40% begrenzt.

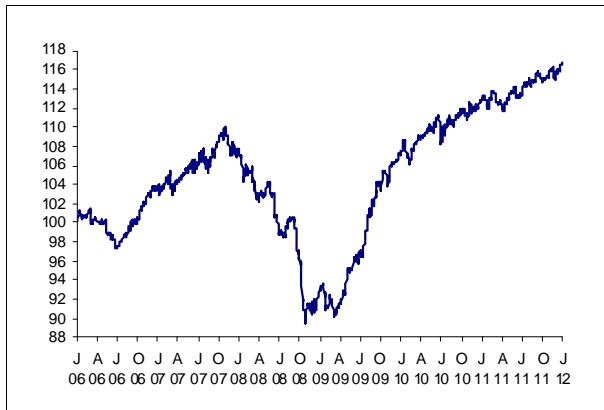
Die strategische Ausrichtung des Fonds ergibt sich aus der Betrachtung von Risikobudgets unter Beachtung von Korrelationseigenschaften. Jeder von acht Märkten, die auf Grund von Korrelations- und Diversifikationseigenschaften besonders attraktiv erscheinen, trägt mit gleichem Risikobeitrag zum Gesamtrisiko bei. Auf Basis eines quantitativen Mehrfaktor-Asset-Allokation Modells erfolgt monatlich eine aktive taktische Allokationsentscheidung. Das lernende System trägt der Veränderung von Einflussfaktoren Rechnung, indem monatlich die über einen gleitenden Zeitraum von 48 Monaten signifikanten Werte ermittelt und für eine Monatsprognose verwendet werden.

WKN / ISIN: A0ER3K / DE000A0ER3K3
 Fondswährung: Euro
 Auflegung: 2. Januar 2006
 Geschäftsjahr: 1.12.-30.11.
 Mindestanlage: EUR 1 Mio.
 Max. Ausgabeaufschlag: 2%
 Verwaltungsgebühr p.a.: 0,40%
 Depotbank: Landesbank Hessen-Thüringen
 Depotbankgebühr p.a.: 0,05%
 Vertriebszulassung: Deutschland

Fondsvermögen: EUR 4,96 Mio.
 Anteilswert: EUR 49,61
 Jahreshöchst 2011: EUR 50,29
 Jahrestiefst 2011: EUR 48,25
 Ausschüttung: EUR 0,80 (21.12.10)
 TER*: 0,87%
 Anteilspreisveröffentlichung: WM, Telekurs, Reuters (A0E R3KX.DX), Bloomberg, www.helaba-invest.de

* Gesamtkosten im Verhältnis zum durchschnittlichen Fondsvolumen

Wertentwicklung



Wertentwicklung seit Auflegung: 16,82%
 Wertentwicklung seit Auflegung p.a.: 2,62%
 Wertentwicklung im lfd. Kalenderjahr: 3,60%

Risikoermittlung gemäß MaRisk:

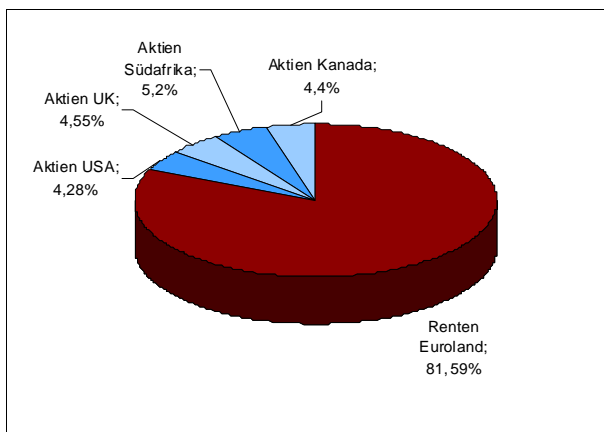
- 1. Volatilität 2,58% p.a.
- 2. Risiko Normal-Case¹ -0,83%
- 3. Risiko Worst-Case² -2,02%

¹ Parameter: 95%Konfidenzniveau,

10 Tage Haltdauer

² Parameter: 4-fache Standardabweichung,
 10 Tage Haltdauer

Asset Allokation



Kennzahlen*

Ø Restlaufzeit: 2,02 Jahre
 Ø Rendite: 2,78 %
 Ø Kupon: 2,38 %
 Ø Duration: 1,90 Jahre
 Duration (mod.): 1,89 %
 Ø Rating: AAA
 (mit Kasse)

*ohne Fondsanteile

Diese Angaben wurden mit großer Sorgfalt zusammengestellt. Für die Richtigkeit und Vollständigkeit der Angaben kann jedoch keine Gewähr übernommen werden. Eine Haftung für allfällige Schäden, die direkt oder indirekt mit den vorliegenden Informationen zusammenhängen, ist ausgeschlossen. Der Monatsbericht bildet keine Offerte zum Kauf von Anteilen. Auf der Grundlage dieses Monatsberichts darf kein Kaufauftrag entgegengenommen werden. Der Kauf von Anteilen erfolgt nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes, dem der letzte Jahres- bzw. Halbjahresbericht beigelegt ist. Der Verkaufsprospekt sowie die Halbjahres- und Jahresberichte ist bei der Verwaltungsgesellschaft Helaba Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH erhältlich. Die Wertentwicklung der Vergangenheit ist keine Garantie für die Zukunft. Alle Berechnungen basieren auf Euro.