

## Berechnung CVA

Fonds: 9036T1 GANÉ Global Equity Fund AK A  
Währung: EUR  
ISIN: DE000A3DEBF5  
LEI: 5299008PEOMLF10TE177  
Fondsvermögen: 38.005.864,65  
Anteile in Umlauf: 287.297

Kontrahent ID	Kontrahent	Kontrahent-LEI	KSA Bonitätsstufe Kontrahent	Risikogewicht je Kontrahent (RW)	Standard CVA-Risiko SCVA	Term 1 Fonds (Zwischenergebnis)	Term 2 Fonds (Zwischenergebnis)	CVA-Risiko im Rahmen des Basisansatzes - unhedged BACVA	CVA-Risiko im Rahmen des Basisansatzes - total BACVA	total BACVA in % FV	Zielfonds Anzahl Gegenparteien
---------------	------------	----------------	------------------------------	----------------------------------	--------------------------	---------------------------------	---------------------------------	---	--	---------------------	--------------------------------

Total						0,00	0,00	0,00	davon OTC:	0,00	0,00
-------	--	--	--	--	--	------	------	------	------------	------	------

Fondsvolumen inkl. Forderungen - Fondsvolumen aus Bewertung Differenz						38.005.864,65	38.005.864,65	-0,00			
---	--	--	--	--	--	---------------	---------------	-------	--	--	--

CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten  
Betrag Summe der Risikopositionswerte (OTC-Derivate mit CVA-Charge)  
Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko der OTC-Derivate mit CVA-Relevanz  
Betrag Nominalbetrag CVA-Geschäfte

in % **Formular C25.01**  
0,00 Zeile 20; Spalte 70  
0,00 Zeile 20; Spalte 10  
0,00 Zeile 20; Spalte 20  
0,00 Zeile 20; Spalte 30

38.005.864,65 Default: Fondsvolumen aus Bewertung --> mit Buchwert überschreiben  
**Betrag in Buchwert:**  
[ ]  
[ ]  
[ ]  
[ ]

**ZUSATZINFORMATIONEN:**  
Gruppeninterne Geschäft: CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten  
Gruppeninterne Geschäft: Betrag Summe der Risikopositionswerte  
Gruppeninterne Geschäft: Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko  
CVA-Risiko Betrag aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften  
Betrag Summe der Risikopositionswerte (Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mit CVA-Charge)  
Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mit CVA-Relevanz  
Aggregation systematischer Komponenten des CVA-Risikos  
Aggregation spezifischer Komponenten des CVA-Risikos

0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 70  
0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 10  
0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 20  
0,00 Zeile 130; Spalte 70  
0,00 Zeile 130; Spalte 10  
0,00 Zeile 130; Spalte 20  
0,00 Zeile 230; Spalte 70  
0,00 Zeile 240; Spalte 70

[ ]  
[ ]  
[ ]  
[ ]  
[ ]  
[ ]  
[ ]  
[ ]