



grundbesitz global
(WKN: RC: 980705; IC: A0NCT9; ISIN: RC: DE0009807057; IC: DE000A0NCT95)

CVA-Report per: 29.02.2024

	EAD	Risikogewichteter KSA Positionswert	CVA
absolut:	95.736.127,78	38.848.244,36	5.780.825,19
relativ:	2,48%	1,01%	0,15%

Counterpart	Position	CVA Gewichtungs- faktor	Rest- lauf- zeit	Replacement Costs	Potential Future Exposure	EAD (Exposure der offenen Derivate)	KSA Risikogewicht	Risikogewichteter KSA Positionswert	CVA Charge
Deutsche Bank AG	FX Forward	0,80%	3,29	13.388.463,90	10.145.279,11	32.947.240,21	50,00%	16.473.620,10	2.019.254,17
Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	FX Forward	0,80%	4,17	9.462.669,71	2.212.179,50	16.344.788,89	50,00%	8.172.394,44	1.268.985,24
J.P. Morgan AG	FX Forward	0,70%	4,35	6.250.598,37	846.753,82	9.936.293,06	20,00%	1.987.258,61	704.343,18
Goldman Sachs Bank Europe SE	FX Forward	0,80%	0,40	2.602.758,68	610.490,57	4.498.548,95	50,00%	2.249.274,48	83.852,95
Nomura Financial Products Europe GmbH	FX Forward	1,00%	8,13	9.272.581,94	5.105.826,67	20.129.772,05	20,00%	4.025.954,41	3.811.385,64
Morgan Stanley Europe SE	FX Forward	0,80%	3,56	2.828.489,23	1.850.053,19	6.549.959,39	50,00%	3.274.979,69	434.441,34
HSBC Continental Europe SA	FX Forward	0,80%	0,35	1.000.000,00	2.806.803,74	5.329.525,23	50,00%	2.664.762,61	99.342,35

Dieses Dokument dient ausschließlich zur Information von Anlegern über ihr bestehendes Investment und ggf. zur Erfüllung von deren eigenen regulatorischen Berichtspflichten.
Jede dafür nicht erforderliche Weitergabe an Dritte und jede Verwendung für andere Zwecke ist untersagt. Es handelt sich bei den Informationen in diesem Dokument nicht um Anlageberatung.
Auf der Grundlage dieses Dokumentes sollten keine Investitionsentscheidungen getroffen werden. Wertentwicklungen der Vergangenheit sind kein geeigneter Indikator für die künftige Entwicklung.