

Berechnung CVA



Fonds: 1369T1 DUI Wertfinder Anteilklasse I
 Währung: EUR
 ISIN: DE000A0NEBA1
 LEI: 549300Q4THVRZB25C325
 Fondsvermögen: 86.055.323,73
 Anteile in Umlauf: 1.023.244

Auswertung per: 20.4.2026 23:45
 Bewertungsdatum: 20.4.2026 23:45

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								86.055.323,73			
- Fondsvolumen aus Bewertung								86.055.323,73			
Differenz								0,00			

		86.055.323,73	Default: Fondsvolumen aus Bewertung --> mit Buchwert überschreiben
	in % Formular C25.01	Betrag in Buchwert:	
CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten	0,00 Zeile 20; Spalte 70		-
Betrag Summe der Risikopositionswerte (OTC-Derivate mit CVA-Charge)	0,00 Zeile 20; Spalte 10		-
Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko der OTC-Derivate mit CVA-Relevanz	0,00 Zeile 20; Spalte 20		-
Betrag Nominalbetrag CVA-Geschäfte	0,00 Zeile 20; Spalte 30		-
ZUSATZINFORMATIONEN:			
Gruppeninterne Geschäft: CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten	0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 70		-
Gruppeninterne Geschäft: Betrag Summe der Risikopositionswerte	0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 10		-
Gruppeninterne Geschäft: Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko	0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 20		-
CVA-Risiko Betrag aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften	0,00 Zeile 130; Spalte 70		-
Betrag Summe der Risikopositionswerte (Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mit CVA-Charge)	0,00 Zeile 130; Spalte 10		-
Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mit CVA-Relevanz	0,00 Zeile 130; Spalte 20		-
Aggregation systematischer Komponenten des CVA-Risikos	0,00 Zeile 230; Spalte 70		-
Aggregation spezifischer Komponenten des CVA-Risikos	0,00 Zeile 240; Spalte 70		-