

Berechnung CVA



Fonds: 1369T1 DUI Wertfinder Anteilklasse I
 Währung: EUR
 ISIN: DE000A0NEBA1
 LEI: 549300Q4THVRZB25C325
 Fondsvermögen: 87.575.409,95
 Anteile in Umlauf: 1.023.034

Auswertung per: 20.5.2026 23:45
 Bewertungsdatum: 20.5.2026 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								87.575.409,95				
- Fondsvolumen aus Bewertung								87.575.409,95				
Differenz								-0,00				

		87.575.409,95	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	-	