Berechnung CVA

Universal Investment

Fonds:	2495T2 Capitulum Rentenstrategie optimiert Universal AK I
Währung:	EUR
ISIN:	DE000A2H7NS5
LEI:	529900TPRL463RQSZ276
Fondsvermögen:	62.415.084,23
Anteile in Umlauf:	604.988

Auswertung per: 20.7.2026 23:45
Bewertungsdatum: 20.7.2026 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	62.415.084,23
- Fondsvolumen aus Bewertung	62.415.084,23
Differenz	0,00

62.415.084,23 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	-
Aggregierung systematischer Komponenten des CVA-Risikos	0,00	Zeile 230; Spalte 70	-
Aggregierung spezifischer Komponenten des CVA-Risikos	0,00	Zeile 240; Spalte 70	-