

# Berechnung CVA



Fonds: 2495T2 Capitulum Rentenstrategie optimiert Universal AK I  
 Währung: EUR  
 ISIN: DE000A2H7NS5  
 LEI: 529900TPRL463RQSZ276  
 Fondsvermögen: 59.971.452,29  
 Anteile in Umlauf: 587.800

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
<b>Total</b>								<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	
								davon OTC:	0,00	0,00	
Fondsvolumen inkl. Forderungen								59.971.452,29			
- Fondsvolumen aus Bewertung								59.971.452,29			
Differenz								0,00			

		59.971.452,29	Default: Fondsvolumen aus Bewertung --> mit Buchwert überschreiben
	<b>in % Formular C25.01</b>	<b>Betrag in Buchwert:</b>	
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	-	
<b>ZUSATZINFORMATIONEN:</b>			
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	-	