Berechnung CVA



Auswertung per: 20.11.2025 23:45 Bewertungsdatum: 20.11.2025 23:45

2495T2 Capitulum Rentenstrategie optimiert Universal AK I EUR DE000A2H7NS5 529900TPR463RQSZ276 51.710.944,73 504.561 Fonds: Währung:

ISIN:

LEI:

Fondsvermögen: Anteile in Umlauf:

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 - B unhedged BACVA	CVA-Risiko im Rahmen des asisansatzes - total BACVA		Zielfonds Anzah Gegenparteier
Total								0,00 d	0,00 avon OTC:	•	
Fondsvolumen inkl. Forderun - Fondsvolumen aus Bewertu Differenz								51.710.944,73 51.710.944,73 -0,00			
		E Betrag Eigenmittelanforderung	etrag Summe der Risikopos aus dem Gegenparteiausfa	sitionswerte (OTC-Derivat		0,00 Zeil 0,00 Zeil 0,00 Zeil	mular C25.01 e 20; Spalte 70 e 20; Spalte 10 e 20; Spalte 20 e 20; Spalte 30	51.710.944,73 d Betrag in Buchwert: - - - -	efault: Marktwert des	Fonds> mit Bud	chwert überschreiber
		Gruppeninterne Ge	Gruppeninterne Gesc Gruppeninterne Gesch schäft: Betrag Eigenmittelan	häft: CVA-Risiko Betrag äft: Betrag Summe der l	Risikopositionswerte	0,00 Zeil	e 40 u. 90; Spalte 70 e 40 u. 90; Spalte 10 e 40 u. 90; Spalte 20				
		Betrag Summe der Ri Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparr	sikopositionswerte (Wertpap		fte mit CVA-Charge)	0,00 Zeil	e 130; Spalte 70 e 130 Spalte 10 e 130; Soalte 20	-			