

Berechnung CVA



Fonds: 2495T2 Capitulum Rentenstrategie optimiert Universal AK I
Währung: EUR
ISIN: DE000A2H7NS5
LEI: 529900TPRL463RQSZ276
Fondsvermögen: 53.445.471,93
Anteile in Umlauf: 514.031

Auswertung per: 20.1.2026 23:45
Bewertungsdatum: 20.1.2026 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								53.445.471,93			
- Fondsvolumen aus Bewertung								53.445.471,93			
Differenz								-0,00			

CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten			in % Formular C25.01	53.445.471,93 default: Marktwert des Fonds --> mit Buchwert überschreiben
Betrag Summe der Risikopositionswerte (OTC-Derivate mit CVA-Charge)			0,00 Zeile 20; Spalte 70	Betrag in Buchwert:
Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko der OTC-Derivate mit CVA-Relevanz			0,00 Zeile 20; Spalte 10	-
Betrag Nominalbetrag CVA-Geschäfte			0,00 Zeile 20; Spalte 20	-
			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; Soalte 20	-