

# Solva-Deckblatt

Fonds: 2495T2 Capitulum Rentenstrategie optimiert Universal AK I  
 Währung: EUR  
 ISIN: DE000A2H7NS5  
 LEI: 529900TPRL463RQSZ276  
 CRR-III-Regeln / Jahr: 2025

Auswertung per: 20.3.2025 23:45  
 Bewertungsdatum: 20.3.2025 23:45

<b>Fondsvermögen</b>	
Fondsvermögen aus Solva:	40.745.080,93
Fondsvermögen aus Bewertung:	40.745.080,92
Differenz:	0,01
<b>Anteile in Umlauf:</b>	<b>399.907,09</b>

<b>Währungsgesamtposition (aktivische Ausrichtung)</b>		
Währung	1.133.037,60	2,781%
Gold		0,000%
N.A.		0,000%
<b>Total</b>	<b>1.133.037,60</b>	<b>2,781%</b>

<b>Durchschnittliche Gewichtungsziffer</b>	
Durchschn. Gew. Ziffer	109,13%
<b>marktbewerteter risikogew. KSA-Positionswert gem. CRR</b>	<b>44.464.697,76</b>

<b>Risikogewicht gemäß Art. 132 (7) CRR i.V.m. Art. 132c (1) CRR [= alternativer LTA]:</b>	<b>105,314%</b>
wobei:	
risikogewichteter Positionswert gem. Art. 132a (1) CRR [=RWAE]:	44.464.697,76
Riskopositionswert [=E]	43.090.875,59
Bruttofondsvermögen [=A]	41.584.398,21
Nettobondsvermögen (abzgl. FK) [=EQ]	40.745.080,93

## Gliederung der Währungspositionen

Whg	Betrag (aktiv)		Betrag (passiv)		aktivische Ausrichtung		passivische Ausrichtung		Nettoposition	in %
	Betrag	in %	Betrag	in %	Betrag	in %	Betrag	in %		
CAD	76.258,46	0,187	72.599,23	0,178	3.659,23	0,009	0,00	0,000	3.659,23	0,009
CHF	153.402,89	0,376	144.405,29	0,354	8.997,60	0,022	0,00	0,000	8.997,60	0,022
GBP	584.867,34	1,435	510.578,83	1,253	74.288,51	0,182	0,00	0,000	74.288,51	0,182
JPY	1.689,47	0,004	0,00	0,000	1.689,47	0,004	0,00	0,000	1.689,47	0,004
NOK	0,01	0,000	0,00	0,000	0,01	0,000	0,00	0,000	0,01	0,000
USD	15.961.944,70	39,175	15.126.527,63	37,125	835.417,07	2,050	0,00	0,000	835.417,07	2,050
XOF	208.985,72	0,513	0,00	0,000	208.985,72	0,513	0,00	0,000	208.985,72	0,513
<b>Total</b>	<b>16.987.148,59</b>	<b>41,691</b>	<b>15.854.110,98</b>	<b>38,910</b>	<b>1.133.037,60</b>	<b>2,781</b>	<b>0,00</b>	<b>0,000</b>	<b>1.133.037,60</b>	<b>2,781</b>

## Gliederung Gold und N.A.

Whg	Betrag (aktiv)	in %	Betrag (passiv)	in %	anzurechnender Betrag	in %
<b>Total Gold und N.A.</b>					<b>0,00</b>	<b>0,000</b>
<b>Übertrag total Währungen (aktivische Ausrichtung)</b>					<b>1.133.037,60</b>	<b>2,781</b>
<b>Währungsgesamtposition (aktivische Ausrichtung)</b>					<b>1.133.037,60</b>	<b>2,781</b>

**Gliederung Gold und N.A.**

<b>Whg</b>	<b>Betrag (aktiv)</b>	<b>in %</b>	<b>Betrag (passiv)</b>	<b>in %</b>	<b>anzurechnender Betrag</b>	<b>in %</b>
------------	-----------------------	-------------	------------------------	-------------	------------------------------	-------------

N.A. = Nicht aufgliederbare Fondsanteile

**CVA-Charge**

Zuschlag CVA-Charge in % vom Fondsvermögen

0,00000

# KSA-Risikogewichte nach Ländern

Fonds: 2495T2 Capitulum Rentenstrategie optimiert Universal AK I  
 Währung: EUR  
 ISIN: DE000A2H7NS5  
 LEI: 529900TPRL463RQSZ276

Auswertung per: 20.3.2025 23:45  
 Bewertungsdatum: 20.3.2025 23:45

## Fondsvermögen

Fondsvermögen aus Solva:	40.745.080,93
Fondsvermögen aus Bewertung:	40.745.080,92
Differenz:	0,01

## Durchschnittliche Gewichtungsziffer

Risikogewicht gemäß Art. 132 (7) CRR i.V.m. Art. 132c (1) CRR [= alternativer LTA]:	105,31%
marktbewerteter risikogew. KSA-Positionswert gem. CRR	44.464.697,76

## Risikogewichteter KSA-Positionswert (in %FV) nach Ländern zur Ermittlung des antizyklischen Puffers (gem. Artikel 130 (1) CRD-IV)

Emittentenland ID	Emittentenland	Bemessungsgrundlage	Bemessungsgrundlage in % am Fondsvermögen	mit Landquote bzw. Risikogewicht gewichteter KSA-Positionswert in EUR	risikogewichteter KSA- Positionswert in % am Fondsvermögen	festgelegte Kapitalpuffer der Länder in % <i>(Angaben ohne Gewähr; Quellen: ESRB und BIS)</i>
AE	Ver.Arabische Emirate	223.706,36	0,5298	251.027,01	0,5946	n/a
AR	Argentinien	76.638,78	0,1815	114.958,17	0,2723	0,0000
AT	Österreich	392.757,93	0,9302	451.710,41	1,0699	0,0000
BE	Belgien	257.258,65	0,6093	257.258,65	0,6093	1,0000
BG	Bulgarien	230.464,45	0,5459	230.464,45	0,5459	2,0000
BH	Bahrain	108.561,34	0,2571	162.842,01	0,3857	n/a
BM	Bermuda	230.063,91	0,5449	292.080,67	0,6918	n/a
BR	Brasilien	285.223,99	0,6755	388.076,97	0,9192	0,0000
CA	Canada	288.735,01	0,6839	288.735,01	0,6839	0,0000
CL	Chile	60.298,01	0,1428	60.298,01	0,1428	0,5000
CN	China	117.130,58	0,2774	87.847,94	0,2081	0,0000
CO	Kolumbien	195.746,83	0,4636	195.746,83	0,4636	n/a
CR	Costa Rica	112.494,60	0,2664	112.494,60	0,2664	n/a
CZ	Tschechische Republik	340.471,66	0,8064	312.614,53	0,7404	1,2500
DE	Bundesrep. Deutschland	4.331.454,11	10,2590	4.880.929,14	11,5604	0,7500
DK	Dänemark	313.356,76	0,7422	313.356,76	0,7422	2,5000
DO	Dominikanische Republik	103.744,46	0,2457	103.744,46	0,2457	n/a
EE	Estland	251.846,37	0,5965	220.773,52	0,5229	1,5000
EG	Ägypten	45.338,07	0,1074	68.007,11	0,1611	n/a
ES	Spanien	566.330,83	1,3413	623.526,76	1,4768	0,0000
ET	Äthiopien	92.323,16	0,2187	138.484,74	0,3280	n/a
FI	Finnland	364.903,56	0,8643	425.189,98	1,0071	0,0000
FR	Frankreich	3.694.161,04	8,7496	3.749.293,68	8,8801	1,0000
GB	Großbritannien	695.731,24	1,6478	750.033,46	1,7764	2,0000
GE	Georgien	95.870,20	0,2271	95.870,20	0,2271	n/a
GR	Griechenland	128.726,66	0,3049	193.089,99	0,4573	0,0000
GT	Guatemala	109.146,16	0,2585	109.146,16	0,2585	n/a
HK	Hongkong	226.048,31	0,5354	226.048,31	0,5354	0,5000
HN	Honduras	106.081,94	0,2513	159.122,90	0,3769	n/a

Risikogewichteter KSA-Positionswert (in %FV) nach Ländern zur Ermittlung des antizyklischen Puffers (gem. Artikel 130 (1) CRD-IV)

Emittentenland ID	Emittentenland	Bemessungsgrundlage	Bemessungsgrundlage in % am Fondsvermögen	mit Landquote bzw. Risikogewicht gewichteter KSA-Positionswert in EUR	risikogewichteter KSA- Positionswert in % am Fondsvermögen	festgelegte Kapitalpuffer der Länder in % <i>(Angaben ohne Gewähr; Quellen: ESRB und BIS)</i>
HU	Ungarn	229.366,11	0,5432	344.049,16	0,8149	0,5000
ID	Indonesien	114.393,25	0,2709	89.199,42	0,2113	0,0000
IE	Irland	333.554,79	0,7900	392.308,09	0,9292	1,5000
IL	Israel	139.241,02	0,3298	139.241,02	0,3298	n/a
IN	Indien	104.593,77	0,2477	104.593,77	0,2477	0,0000
IS	Island	112.432,28	0,2663	112.432,28	0,2663	2,5000
IT	Italien	239.094,71	0,5663	239.094,71	0,5663	0,0000
JM	Jamaika	65.554,74	0,1553	65.554,74	0,1553	n/a
KW	Kuwait	101.837,05	0,2412	152.755,58	0,3618	n/a
KZ	Kasachstan	107.175,07	0,2538	107.175,07	0,2538	n/a
LB	Libanon	87.898,24	0,2082	131.847,36	0,3123	n/a
LK	Sri Lanka	100.389,38	0,2378	150.584,06	0,3567	n/a
LU	Luxemburg	587.634,12	1,3918	649.085,62	1,5374	0,5000
LV	Lettland	132.798,58	0,3145	199.197,87	0,4718	0,5000
MC	Monaco	238,28	0,0006	238,28	0,0006	n/a
MN	Mongolei	334.774,13	0,7929	502.161,19	1,1894	n/a
MU	Mauritius	47.361,20	0,1122	47.361,20	0,1122	n/a
MV	Malediven	94.151,77	0,2230	141.227,66	0,3345	n/a
MX	Mexiko	1.041.049,45	2,4657	1.506.235,97	3,5675	0,0000
NG	Nigeria	117.222,34	0,2776	175.833,51	0,4165	n/a
NL	Niederlande	1.445.800,69	3,4244	1.554.469,49	3,6817	2,0000
NO	Norwegen	130.967,03	0,3102	130.967,03	0,3102	2,5000
PA	Panama	81.478,80	0,1930	122.218,19	0,2895	n/a
PE	Peru	260.647,30	0,6173	336.972,58	0,7981	n/a
PH	Philippinen	104.853,54	0,2483	104.853,54	0,2483	0,0000
PK	Pakistan	178.791,04	0,4235	268.186,56	0,6352	n/a
PL	Polen	110.714,36	0,2622	83.035,77	0,1967	0,0000
PT	Portugal	243.795,31	0,5774	305.154,10	0,7228	0,0000
RO	Rumänien	479.785,33	1,1364	630.312,95	1,4929	1,0000
RS	Serbien und Kosovo	110.226,80	0,2611	110.226,80	0,2611	n/a
RU	Rußland	323.721,94	0,7667	323.721,94	0,7667	0,0000
SE	Schweden	71.339,31	0,1690	71.339,31	0,1690	2,0000
SG	Singapur	84.680,17	0,2006	84.680,17	0,2006	0,0000
SI	Slowenien	409.959,12	0,9710	614.938,68	1,4565	1,0000
SK	Slowakei	209.028,12	0,4951	184.728,83	0,4375	1,5000
SNAT	SNAT	727.558,50	1,7232	745.219,60	1,7650	n/a
TG	Togo	333.170,67	0,7891	499.756,00	1,1837	n/a
TR	Türkei	771.176,96	1,8265	991.053,29	2,3473	0,0000
TT	Trinidad und Tobago	220.944,71	0,5233	277.497,03	0,6573	n/a
UA	Ukraine	920.302,17	2,1797	1.303.296,29	3,0868	n/a
US	USA	1.226.702,92	2,9054	1.463.553,21	3,4664	0,0000
UZ	Usbekistan	763.230,98	1,8077	865.244,85	2,0493	n/a
VE	Venezuela	59.143,80	0,1401	88.715,70	0,2101	n/a
VG	Brit. Jungfern-Inseln	106.002,37	0,2511	106.002,37	0,2511	n/a
ZA	Südafrika	331.143,65	0,7843	387.197,92	0,9171	0,0000
<b>Zwischensumme</b>		<b>27.840.540,84</b>	<b>65,9398</b>	<b>32.166.291,18</b>	<b>76,1853</b>	
BF-Artikel 140 (4) CRD IV befreit		15.250.235,25	36,1199	12.298.307,09	29,1283	
Herkunftsland gem. Art. 2(5) a oder Art. 4(3) Del. VO (EU) 1152/2014		99,49	0,0002	99,49	0,0002	
<b>Total</b>		<b>43.090.875,59</b>	<b>102,0599</b>	<b>44.464.697,76</b>	<b>105,3138</b>	

Details zu den Positionen mit Herkunftsland-Prinzip gem. Art. 2(5) a oder Art. 4(3) Del. VO (EU) 1152/2014:

Risikogewichteter KSA-Positionswert (in %FV) nach Ländern zur Ermittlung des antizyklischen Puffers (gem. Artikel 130 (1) CRD-IV)

Emittentenland ID	Emittentenland	Bemessungsgrundlage	Bemessungsgrundlage in % am Fondsvermögen	mit Landquote bzw. Risikogewicht gewichteter KSA-Positionswert in EUR	risikogewichteter KSA- Positionswert in % am Fondsvermögen	festgelegte Kapitalpuffer der Länder in % <i>(Angaben ohne Gewähr; Quellen: ESRB und BIS)</i>
ISIN	Positionsbezeichnung	Bemessungsgrundlage	Bemessungsgrundlage in % am Fondsvermögen	mit Landquote bzw. Risikogewicht gewichteter KSA-Positionswert in EUR	risikogewichteter KSA- Positionswert in % am Fondsvermögen	
SoForCSDR-EUR-249501	Sonstige Forderungen aus CSDR		99,49	0,0002	99,49	0,0002