

# Solva-Deckblatt



Fonds: 2495T2 Capitulum Rentenstrategie optimiert Universal AK I  
 Wahrung: EUR  
 ISIN: DE000A2H7NS5  
 LEI: 529900TPRL463RQSZ276  
 CRR-III-Regeln / Jahr: 2026

Auswertung per: 20.4.2026 23:45  
 Bewertungsdatum: 20.4.2026 23:45

**Fondsvermogen**  
 Fondsvermogen aus Solva: 60.456.105,10  
 Fondsvermogen aus Bewertung: 60.456.105,11  
 Differenz: -0,01  
**Anteile in Umlauf: 575.032,83**

Wahrungsgesamtposition (aktivische Ausrichtung)		
Wahrung	1.111.358,41	1,838%
Gold		0,000%
N.A.		0,000%
<b>Total</b>	<b>1.111.358,41</b>	<b>1,838%</b>

**Durchschnittliche Gewichtungsziffer**  
 Durchschn. Gew. Ziffer 118,76%  
**marktbewerteter risikogew. KSA-Positionswert gem. CRR 71.798.923,94**

<b>Risikogewicht gema Art. 132 (7) CRR i.V.m. Art. 132c (1) CRR [= alternativer LTA]:</b>	<b>114,505%</b>
wobei:	
risikogewichteter Positionswert gem. Art. 132a (1) CRR [=RWAE]:	71.798.923,94
Riskositionswert [=E]	63.619.424,18
Bruttofondsvermogen [=A]	61.338.787,48
Nettofondsvermogen (abzgl. FK) [=EQ]	60.456.105,10

## Gliederung der Wahrungspitionen

Whg	Betrag (aktiv)		Betrag (passiv)		aktivische Ausrichtung		passivische Ausrichtung		Nettoposition	
	Betrag	in %	Betrag	in %	Betrag	in %	Betrag	in %	Betrag	in %
CAD	451.897,23	0,747	436.701,95	0,722	15.195,28	0,025	0,00	0,000	15.195,28	0,025
CHF	276.446,14	0,457	290.177,89	0,480	0,00	0,000	13.731,75	0,023	-13.731,75	-0,023
GBP	876.272,38	1,449	875.774,20	1,449	498,19	0,001	0,00	0,000	498,19	0,001
USD	23.033.321,50	38,099	22.188.371,85	36,702	844.949,65	1,398	0,00	0,000	844.949,65	1,398
XOF	250.715,29	0,415	0,00	0,000	250.715,29	0,415	0,00	0,000	250.715,29	0,415
<b>Total</b>	<b>24.888.652,55</b>	<b>41,168</b>	<b>23.791.025,88</b>	<b>39,353</b>	<b>1.111.358,41</b>	<b>1,838</b>	<b>13.731,75</b>	<b>0,023</b>	<b>1.097.626,66</b>	<b>1,816</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>ubertrag total Wahrungen (aktivische Ausrichtung)</b>					<b>1.111.358,41</b>	<b>1,838</b>
<b>Wahrungsgesamtposition (aktivische Ausrichtung)</b>					<b>1.111.358,41</b>	<b>1,838</b>

N.A. = Nicht aufgliederbare Fondsanteile

**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>
<b>CVA-Charge</b>						
Zuschlag CVA-Charge in % vom Fondsvermögen				0,00000		

**Hinweise**

Due Diligence gem. Art. 113  
CRR: Es liegen uns aktuell  
keine Erkenntnisse vor, die  
ein Bonitätsdowngrade  
bestimmter Papiere oder  
Emittenten erforderlich  
machen.

# KSA-Risikogewichte nach Ländern

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

Auswertung per: 20.4.2026 23:45  
 Bewertungsdatum: 20.4.2026 23:45

## Fondsvermögen

Fondsvermögen aus Solva: 60.456.105,10  
 Fondsvermögen aus Bewertung: 60.456.105,11  
 Differenz: -0,01

## Durchschnittliche Gewichtungsziffer

Risikogewicht gemäß Art. 132 (7) CRR i.V.m. Art. 132c (1) CRR [= alternativer LTA]: 114,51%  
**marktbewerteter risikogew. KSA-Positionswert gem. CRR 71.798.923,94**

## 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	502.315,00	0,8011	596.790,94	0,9518	n/a
AM	Armenien	101.296,41	0,1615	101.296,41	0,1616	1,5000
AO	Angola	294.117,68	0,4691	294.117,68	0,4691	n/a
AR	Argentinien	198.731,44	0,3169	298.097,15	0,4754	0,0000
AT	Österreich	722.095,94	1,1516	1.009.710,31	1,6103	0,0000
BE	Belgien	378.494,04	0,6036	515.411,86	0,8220	1,0000
BG	Bulgarien	361.232,24	0,5761	361.232,24	0,5761	2,0000
BJ	Benin	97.172,43	0,1550	145.758,64	0,2325	n/a
BM	Bermuda	320.877,30	0,5117	481.315,95	0,7676	n/a
BR	Brasilien	651.629,52	1,0392	937.945,63	1,4958	0,0000
CA	Canada	882.884,55	1,4080	1.155.942,97	1,8435	0,0000
CH	Schweiz	118.059,87	0,1883	177.089,81	0,2824	0,0000
CN	China	329.370,33	0,5253	333.347,55	0,5316	0,0000
CO	Kolumbien	379.862,82	0,6058	432.210,09	0,6893	n/a
CY	Zypern	117.967,43	0,1881	176.951,15	0,2822	1,5000
CZ	Tschechische Republik	356.395,53	0,5684	418.292,72	0,6671	1,2500
DE	Bundesrep. Deutschland	7.885.290,81	12,5754	9.273.083,42	14,7887	0,7500
DK	Dänemark	558.182,23	0,8902	654.912,23	1,0445	2,5000
DO	Dominikanische Republik	99.548,31	0,1588	99.548,31	0,1588	n/a
EE	Estland	375.548,11	0,5989	512.478,40	0,8173	1,5000
EG	Ägypten	152.422,94	0,2431	228.634,40	0,3646	n/a
ES	Spanien	560.982,20	0,8947	735.367,06	1,1728	0,0000
ET	Äthiopien	102.541,72	0,1635	153.812,57	0,2453	n/a
FI	Finnland	836.068,74	1,3334	1.003.523,69	1,6004	0,0000
FR	Frankreich	5.761.774,41	9,1889	7.508.274,82	11,9742	1,0000
GB	Großbritannien	1.627.848,96	2,5961	2.058.767,55	3,2833	2,0000
GE	Georgien	96.452,10	0,1538	96.452,10	0,1538	n/a
GR	Griechenland	260.364,55	0,4152	390.546,83	0,6228	0,2500
GT	Guatemala	99.491,08	0,1587	99.491,08	0,1587	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>
HK	Hongkong	548.928,93	0,8754	583.289,52	0,9302	0,5000
HU	Ungarn	437.483,82	0,6977	606.429,76	0,9671	1,0000
ID	Indonesien	217.006,13	0,3461	220.753,61	0,3521	0,0000
IE	Irland	599.074,39	0,9554	769.470,51	1,2272	1,5000
IL	Israel	258.123,95	0,4117	317.038,49	0,5056	n/a
IN	Indien	297.166,06	0,4739	297.166,06	0,4739	0,0000
IS	Island	100.507,01	0,1603	130.659,12	0,2084	2,5000
IT	Italien	581.031,14	0,9266	777.466,16	1,2399	0,0000
JM	Jamaika	156.927,25	0,2503	156.927,25	0,2503	n/a
JP	Japan	231.455,08	0,3691	300.891,60	0,4799	0,0000
KG	Kirgisische Republik	99.103,45	0,1580	99.103,45	0,1581	n/a
KW	Kuwait	98.002,35	0,1563	147.003,53	0,2344	n/a
KY	Kaimaninseln	100.340,68	0,1600	150.511,02	0,2400	n/a
KZ	Kasachstan	209.612,05	0,3343	241.429,77	0,3850	n/a
LB	Libanon	123.372,03	0,1968	185.058,04	0,2951	n/a
LU	Luxemburg	1.506.865,37	2,4031	1.461.055,98	2,3301	0,5000
LV	Lettland	168.147,69	0,2682	228.439,93	0,3643	1,0000
MA	Marokko	198.676,61	0,3168	298.014,92	0,4753	n/a
MN	Mongolei	414.465,14	0,6610	572.205,43	0,9126	n/a
MU	Mauritius	126.594,27	0,2019	101.728,07	0,1622	n/a
MX	Mexiko	648.351,08	1,0340	744.029,86	1,1866	0,0000
NG	Nigeria	120.732,42	0,1925	181.098,62	0,2888	n/a
NL	Niederlande	1.874.554,72	2,9895	2.488.085,70	3,9680	2,0000
NO	Norwegen	471.790,34	0,7524	599.355,83	0,9559	2,5000
OM	Oman	102.077,17	0,1628	132.700,33	0,2116	n/a
PA	Panama	183.118,30	0,2920	254.188,40	0,4054	n/a
PE	Peru	155.141,07	0,2474	232.711,61	0,3711	n/a
PH	Philippinen	201.810,72	0,3218	262.353,94	0,4184	0,0000
PK	Pakistan	97.816,12	0,1560	146.724,18	0,2340	n/a
PL	Polen	116.913,64	0,1865	175.370,46	0,2797	1,0000
PT	Portugal	234.516,30	0,3740	291.748,89	0,4653	0,7500
PY	Paraguay	123.111,10	0,1963	123.111,10	0,1963	n/a
QA	Katar	303.269,11	0,4837	434.659,34	0,6932	n/a
RO	Rumänien	1.081.409,12	1,7246	1.268.458,68	2,0229	1,0000
RS	Serbien und Kosovo	102.335,92	0,1632	102.335,92	0,1632	n/a
RU	Rußland	162.122,32	0,2586	204.039,02	0,3254	n/a
SA	Saudi-Arabien	500.129,36	0,7976	710.242,66	1,1327	0,0000
SE	Schweden	430.922,19	0,6872	584.317,92	0,9319	2,0000
SG	Singapur	302.109,87	0,4818	244.899,12	0,3906	0,0000
SI	Slowenien	594.558,69	0,9482	867.729,74	1,3839	1,0000
SK	Slowakei	102.171,54	0,1629	51.085,77	0,0815	1,5000
SNAT	SNAT	1.202.925,33	1,9184	1.207.682,36	1,9260	n/a
SV	El Salvador	106.706,21	0,1702	160.059,32	0,2553	n/a
TG	Togo	208.943,58	0,3332	313.415,37	0,4998	n/a
TH	Thailand	99.526,35	0,1587	129.384,26	0,2063	n/a
TR	Türkei	1.012.491,45	1,6147	1.366.139,32	2,1787	0,0000
TT	Trinidad und Tobago	307.576,43	0,4905	360.332,78	0,5747	n/a
UA	Ukraine	728.201,62	1,1613	1.092.302,43	1,7420	n/a
US	USA	1.650.638,06	2,6324	2.173.222,59	3,4659	0,0000
UZ	Usbekistan	954.682,94	1,5225	986.812,90	1,5738	n/a
VE	Venezuela	143.200,38	0,2284	214.800,57	0,3426	n/a
ZA	Südafrika	297.346,05	0,4742	328.134,83	0,5233	1,0000
<b>Zwischensumme</b>		<b>45.323.101,59</b>	<b>72,2811</b>	<b>56.326.579,57</b>	<b>89,8294</b>	

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>
BF-Artikel 140 (4) CRD IV befreit		18.296.163,52	29,1787	15.472.185,31	24,6750	
Herkunftsland gem. Art. 2(5) a oder Art. 4(3) Del. VO (EU) 1152/2014		159,07	0,0003	159,07	0,0003	
<b>Total</b>		<b>63.619.424,18</b>	<b>101,4600</b>	<b>71.798.923,94</b>	<b>114,5047</b>	

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

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	159,07	0,0003	159,07	0,0003