

# Solva-Deckblatt



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

Auswertung per: 20.5.2026 23:45  
 Bewertungsdatum: 20.5.2026 23:45

**Fondsvermögen**  
 Fondsvermögen aus Solva: 59.971.452,29  
 Fondsvermögen aus Bewertung: 59.971.452,29  
 Differenz:  
**Anteile in Umlauf: 587.799,73**

**Währungsgesamtposition (aktivische Ausrichtung)**  
 Währung 760.871,71 1,269%  
 Gold 0,000%  
 N.A. 0,000%  
**Total 760.871,71 1,269%**

**Durchschnittliche Gewichtungsziffer**  
 Durchschn. Gew. Ziffer 123,10%  
**marktbewerteter risikogew. KSA-Positionswert gem. CRR 73.821.949,18**

<b>Risikogewicht gemäß Art. 132 (7) CRR i.V.m. Art. 132c (1) CRR [= alternativer LTA]:</b>	<b>119,142%</b>
wobei: risikogewichteter Positionswert gem. Art. 132a (1) CRR [=RWAE]:	73.821.949,18
Riskopositionswert [=E]	63.775.133,37
Bruttofondsvermögen [=A]	61.727.128,06
Nettofondsvermögen (abzgl. FK) [=EQ]	59.971.452,29

## Gliederung der Währungspositionen

Whg	Betrag (aktiv)		Betrag (passiv)		aktivische Ausrichtung		passivische Ausrichtung		Nettoposition	
	Betrag	in %	Betrag	in %	Betrag	in %	Betrag	in %	Betrag	in %
CAD	456.985,10	0,762	434.498,69	0,725	22.486,42	0,038	0,00	0,000	22.486,42	0,038
CHF	275.248,14	0,459	289.054,75	0,482	0,00	0,000	13.806,61	0,023	-13.806,61	-0,023
GBP	834.582,27	1,392	855.637,57	1,427	0,00	0,000	21.055,29	0,035	-21.055,29	-0,035
USD	24.594.084,04	41,010	24.107.844,87	40,199	486.239,17	0,811	0,00	0,000	486.239,17	0,811
XOF	252.146,13	0,420	0,00	0,000	252.146,13	0,420	0,00	0,000	252.146,13	0,420
<b>Total</b>	<b>26.413.045,68</b>	<b>44,043</b>	<b>25.687.035,87</b>	<b>42,832</b>	<b>760.871,71</b>	<b>1,269</b>	<b>34.861,90</b>	<b>0,058</b>	<b>726.009,81</b>	<b>1,211</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>760.871,71</b>	<b>1,269</b>
<b>Währungsgesamtposition (aktivische Ausrichtung)</b>					<b>760.871,71</b>	<b>1,269</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: 20.5.2026 23:45  
 Bewertungsdatum: 20.5.2026 23:45

## Fondsvermögen

Fondsvermögen aus Solva: 59.971.452,29  
 Fondsvermögen aus Bewertung: 59.971.452,29  
 Differenz: 0,00

## Durchschnittliche Gewichtungsziffer

Risikogewicht gemäß Art. 132 (7) CRR i.V.m. Art. 132c (1) CRR [= alternativer LTA]: 119,14%  
**marktbewerteter risikogew. KSA-Positionswert gem. CRR 73.821.949,18**

## 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	509.906,47	0,8229	605.533,80	0,9773	n/a
AM	Armenien	102.299,21	0,1651	102.299,21	0,1651	1,5000
AO	Angola	288.551,28	0,4657	288.551,28	0,4657	n/a
AR	Argentinien	75.584,50	0,1220	113.376,74	0,1830	0,0000
AT	Österreich	717.638,32	1,1582	1.003.500,58	1,6196	0,0000
BE	Belgien	487.046,90	0,7861	679.198,33	1,0962	1,0000
BG	Bulgarien	352.456,07	0,5688	352.456,07	0,5688	2,0000
BJ	Benin	97.139,68	0,1568	145.709,52	0,2352	n/a
BM	Bermuda	321.509,30	0,5189	482.263,95	0,7783	n/a
BR	Brasilien	680.767,58	1,0987	979.910,12	1,5815	0,0000
CA	Canada	1.218.695,31	1,9669	1.527.452,72	2,4652	0,0000
CH	Schweiz	116.737,41	0,1884	175.106,11	0,2826	0,0000
CN	China	328.646,80	0,5304	331.955,52	0,5358	0,0000
CO	Kolumbien	373.757,03	0,6032	425.984,15	0,6875	n/a
CY	Zypern	117.727,32	0,1900	176.590,99	0,2850	1,5000
CZ	Tschechische Republik	358.750,67	0,5790	420.960,91	0,6794	1,2500
DE	Bundesrep. Deutschland	7.347.828,73	11,8588	8.921.691,86	14,3988	0,7500
DK	Dänemark	553.910,34	0,8940	650.463,79	1,0498	2,5000
DO	Dominikanische Republik	98.020,46	0,1582	98.020,46	0,1582	n/a
EE	Estland	371.175,66	0,5990	506.758,79	0,8179	1,5000
EG	Ägypten	50.002,96	0,0807	75.004,44	0,1211	n/a
ES	Spanien	853.618,01	1,3777	1.061.857,91	1,7138	0,0000
ET	Äthiopien	104.736,97	0,1690	157.105,46	0,2536	n/a
FI	Finnland	952.226,87	1,5368	1.120.191,90	1,8079	0,0000
FR	Frankreich	6.121.354,42	9,8793	7.930.677,90	12,7994	1,0000
GB	Großbritannien	1.733.062,02	2,7970	2.166.251,35	3,4961	2,0000
GE	Georgien	97.548,30	0,1574	97.548,30	0,1574	n/a
GR	Griechenland	260.204,93	0,4199	390.307,39	0,6299	0,2500
GT	Guatemala	100.267,68	0,1618	100.267,68	0,1618	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	424.921,77	0,6858	458.798,76	0,7405	0,5000
HU	Ungarn	434.049,39	0,7005	600.990,38	0,9700	1,0000
ID	Indonesien	216.518,44	0,3494	220.794,42	0,3563	0,0000
IE	Irland	592.751,24	0,9566	760.049,77	1,2267	1,5000
IL	Israel	254.262,43	0,4104	313.060,79	0,5053	n/a
IN	Indien	299.807,78	0,4839	299.807,78	0,4839	0,0000
IS	Island	102.171,51	0,1649	132.822,96	0,2144	2,5000
IT	Italien	566.352,83	0,9140	781.421,52	1,2612	0,0000
JM	Jamaika	157.008,76	0,2534	157.008,76	0,2534	n/a
JP	Japan	229.340,09	0,3701	298.142,12	0,4812	0,0000
KG	Kirgisische Republik	99.887,56	0,1612	149.831,34	0,2418	n/a
KW	Kuwait	99.166,51	0,1600	148.749,76	0,2401	n/a
KY	Kaimaninseln	101.449,88	0,1637	152.174,81	0,2456	n/a
KZ	Kasachstan	401.888,85	0,6486	408.187,21	0,6588	n/a
LB	Libanon	115.396,15	0,1862	173.094,23	0,2794	n/a
LU	Luxemburg	1.374.590,87	2,2185	1.361.587,70	2,1975	0,5000
LV	Lettland	157.982,72	0,2550	213.178,55	0,3441	1,0000
MA	Marokko	296.432,78	0,4784	444.649,17	0,7176	n/a
MN	Mongolei	420.030,19	0,6779	579.779,82	0,9357	n/a
MU	Mauritius	129.035,16	0,2083	103.914,26	0,1677	n/a
MX	Mexiko	749.467,52	1,2096	894.556,24	1,4437	0,0000
NG	Nigeria	120.409,81	0,1943	180.614,71	0,2915	n/a
NL	Niederlande	1.880.333,51	3,0347	2.494.983,96	4,0267	2,0000
NO	Norwegen	473.029,74	0,7634	600.358,86	0,9689	2,5000
OM	Oman	199.474,99	0,3219	259.317,49	0,4185	n/a
PA	Panama	184.643,38	0,2980	216.206,27	0,3489	n/a
PE	Peru	159.000,58	0,2566	238.500,88	0,3849	n/a
PH	Philippinen	203.895,92	0,3291	265.064,69	0,4278	0,0000
PK	Pakistan	97.134,97	0,1568	145.702,46	0,2352	n/a
PL	Polen	116.961,00	0,1888	175.441,50	0,2832	1,0000
PT	Portugal	230.680,23	0,3723	287.775,55	0,4644	0,7500
PY	Paraguay	123.848,77	0,1999	123.848,77	0,1999	n/a
QA	Katar	306.707,08	0,4950	439.628,91	0,7095	n/a
RO	Rumänien	1.074.856,66	1,7347	1.261.025,00	2,0352	1,0000
RS	Serbien und Kosovo	432.210,89	0,6976	432.210,89	0,6976	n/a
RU	Rußland	162.152,05	0,2617	203.920,22	0,3291	n/a
SA	Saudi-Arabien	596.651,83	0,9629	855.084,20	1,3800	0,0000
SE	Schweden	428.504,61	0,6916	581.014,78	0,9377	2,0000
SG	Singapur	299.940,70	0,4841	243.359,14	0,3928	0,0000
SI	Slowenien	592.270,40	0,9559	864.448,23	1,3951	1,0000
SK	Slowakei	101.681,95	0,1641	76.261,46	0,1231	1,5000
SNAT	SNAT	1.097.062,18	1,7706	1.127.853,13	1,8203	n/a
SV	El Salvador	107.991,45	0,1743	161.987,18	0,2614	n/a
TG	Togo	311.799,26	0,5032	467.698,88	0,7548	n/a
TH	Thailand	99.553,32	0,1607	129.419,31	0,2089	n/a
TR	Türkei	1.012.829,43	1,6346	1.367.398,64	2,2069	0,0000
TT	Trinidad und Tobago	308.574,65	0,4980	359.820,82	0,5807	n/a
UA	Ukraine	732.620,11	1,1824	1.098.930,17	1,7736	n/a
US	USA	1.644.851,19	2,6546	2.196.670,89	3,5452	0,0000
UZ	Usbekistan	951.332,88	1,5354	982.653,27	1,5859	n/a
VE	Venezuela	146.776,50	0,2369	220.164,75	0,3553	n/a
ZA	Südafrika	304.822,46	0,4920	335.971,81	0,5422	1,0000
<b>Zwischensumme</b>		<b>46.516.286,10</b>	<b>75,0732</b>	<b>58.132.934,37</b>	<b>93,8215</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		17.258.681,47	27,8540	15.688.849,01	25,3204	
Herkunftsland gem. Art. 2(5) a oder Art. 4(3) Del. VO (EU) 1152/2014		165,80	0,0003	165,80	0,0003	
<b>Total</b>		<b>63.775.133,37</b>	<b>102,9275</b>	<b>73.821.949,18</b>	<b>119,1422</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	165,80	0,0003	165,80	0,0003