

Solva-Deckblatt



Fonds: 2496T2 Capitulum Weltzins-Invest Universal AK I
 Währung: EUR
 ISIN: DE000A2H7NU1
 LEI: 529900Q626RC55DLB570

Auswertung per: 21.10.2024 23:45
 Bewertungsdatum: 21.10.2024 23:45

Fondsvermögen
 Fondsvermögen aus Solva: 218.592.281,23
 Fondsvermögen aus Bewertung: 218.592.281,23
 Differenz:
Anteile in Umlauf: 2.667.048,32

Währungsgesamtposition (aktivische Ausrichtung)

Währung	223.762.237,16	102,365%
Gold		0,000%
N.A.		0,000%
Total	223.762.237,16	102,365%

Durchschnittliche Gewichtungsziffer
 Durchschn. Gew. Ziffer 58,57%
marktbewerteter risikogew. KSA-Positionswert gem. CRR 128.029.217,27

Risikogewicht gemäß Art. 132 (7) CRR i.V.m. Art. 132c (1) CRR [= alternativer LTA]:	54,949%
wobei:	
risikogewichteter Positionswert gem. Art. 132a (1) CRR [=RWAE]:	128.029.217,27
Riskopositionswert [=E]	235.018.688,91
Bruttofondsvermögen [=A]	220.490.797,03
Nettofondsvermögen (abzgl. FK) [=EQ]	218.592.281,23

Gliederung der Währungspositionen

Whg	Betrag (aktiv)		Betrag (passiv)		aktivische Ausrichtung		passivische Ausrichtung		Nettoposition	
	Betrag	in %	Betrag	in %	Betrag	in %	Betrag	in %	Betrag	in %
AED	0,00	0,000	4.091.035,98	1,872	0,00	0,000	4.091.035,98	1,872	-4.091.035,98	-1,872
AMD	840.525,32	0,385	0,00	0,000	840.525,32	0,385	0,00	0,000	840.525,32	0,385
AOA	373.669,50	0,171	0,00	0,000	373.669,50	0,171	0,00	0,000	373.669,50	0,171
ARS	5.677.700,51	2,597	0,00	0,000	5.677.700,51	2,597	0,00	0,000	5.677.700,51	2,597
AUD	4.289.433,12	1,962	0,00	0,000	4.289.433,12	1,962	0,00	0,000	4.289.433,12	1,962
AZN	1.630.114,69	0,746	0,00	0,000	1.630.114,69	0,746	0,00	0,000	1.630.114,69	0,746
BDT	2.228.312,18	1,019	0,00	0,000	2.228.312,18	1,019	0,00	0,000	2.228.312,18	1,019
BRL	7.100.817,83	3,248	0,00	0,000	7.100.817,83	3,248	0,00	0,000	7.100.817,83	3,248
BWP	1.237.521,32	0,566	0,00	0,000	1.237.521,32	0,566	0,00	0,000	1.237.521,32	0,566
CAD	1.952.007,02	0,893	0,00	0,000	1.952.007,02	0,893	0,00	0,000	1.952.007,02	0,893
CHF	4.456.632,39	2,039	0,00	0,000	4.456.632,39	2,039	0,00	0,000	4.456.632,39	2,039
CLP	2.514.377,04	1,150	0,00	0,000	2.514.377,04	1,150	0,00	0,000	2.514.377,04	1,150
CNH	0,00	0,000	1.168.968,11	0,535	0,00	0,000	1.168.968,11	0,535	-1.168.968,11	-0,535
CNY	3.116.315,26	1,426	0,00	0,000	3.116.315,26	1,426	0,00	0,000	3.116.315,26	1,426
COP	5.965.711,25	2,729	0,00	0,000	5.965.711,25	2,729	0,00	0,000	5.965.711,25	2,729
CRC	2.445.220,63	1,119	0,00	0,000	2.445.220,63	1,119	0,00	0,000	2.445.220,63	1,119
CZK	6.298.036,97	2,881	0,00	0,000	6.298.036,97	2,881	0,00	0,000	6.298.036,97	2,881
DKK	552.689,48	0,253	0,00	0,000	552.689,48	0,253	0,00	0,000	552.689,48	0,253
DOP	6.970.452,71	3,189	0,00	0,000	6.970.452,71	3,189	0,00	0,000	6.970.452,71	3,189
EGP	4.212.738,45	1,927	0,00	0,000	4.212.738,45	1,927	0,00	0,000	4.212.738,45	1,927
GBP	4.922.049,48	2,252	0,00	0,000	4.922.049,48	2,252	0,00	0,000	4.922.049,48	2,252
GEL	1.954.246,17	0,894	0,00	0,000	1.954.246,17	0,894	0,00	0,000	1.954.246,17	0,894
GHS	1.903.282,63	0,871	0,00	0,000	1.903.282,63	0,871	0,00	0,000	1.903.282,63	0,871

Gliederung der Währungspositionen

GTQ	674.273,95	0,308	0,00	0,000	674.273,95	0,308	0,00	0,000	674.273,95	0,308
HKD	203,32	0,000	6.353.696,41	2,907	0,00	0,000	6.353.493,08	2,907	-6.353.493,08	-2,907
HUF	6.971.838,11	3,189	421.980,59	0,193	6.549.857,51	2,996	0,00	0,000	6.549.857,51	2,996
IDR	6.660.557,89	3,047	0,00	0,000	6.660.557,89	3,047	0,00	0,000	6.660.557,89	3,047
ILS	1.544.553,62	0,707	0,00	0,000	1.544.553,62	0,707	0,00	0,000	1.544.553,62	0,707
INR	6.580.994,88	3,011	0,00	0,000	6.580.994,88	3,011	0,00	0,000	6.580.994,88	3,011
ISK	658.319,14	0,301	0,00	0,000	658.319,14	0,301	0,00	0,000	658.319,14	0,301
JMD	1.846.519,75	0,845	0,00	0,000	1.846.519,75	0,845	0,00	0,000	1.846.519,75	0,845
JPY	2.853.381,18	1,305	0,00	0,000	2.853.381,18	1,305	0,00	0,000	2.853.381,18	1,305
KES	1.978.211,92	0,905	0,00	0,000	1.978.211,92	0,905	0,00	0,000	1.978.211,92	0,905
KGS	1.005.168,72	0,460	0,00	0,000	1.005.168,72	0,460	0,00	0,000	1.005.168,72	0,460
KRW	922.623,98	0,422	0,00	0,000	922.623,98	0,422	0,00	0,000	922.623,98	0,422
KZT	7.030.434,24	3,216	0,00	0,000	7.030.434,24	3,216	0,00	0,000	7.030.434,24	3,216
LKR	774.973,47	0,355	0,00	0,000	774.973,47	0,355	0,00	0,000	774.973,47	0,355
MNT	2.525.105,63	1,155	0,00	0,000	2.525.105,63	1,155	0,00	0,000	2.525.105,63	1,155
MXN	6.388.572,20	2,923	0,00	0,000	6.388.572,20	2,923	0,00	0,000	6.388.572,20	2,923
MYR	4.246.934,78	1,943	0,00	0,000	4.246.934,78	1,943	0,00	0,000	4.246.934,78	1,943
NGN	2.529.571,66	1,157	0,00	0,000	2.529.571,66	1,157	0,00	0,000	2.529.571,66	1,157
NOK	4.160.232,16	1,903	0,00	0,000	4.160.232,16	1,903	0,00	0,000	4.160.232,16	1,903
NZD	4.034.355,82	1,846	0,00	0,000	4.034.355,82	1,846	0,00	0,000	4.034.355,82	1,846
PEN	4.267.596,07	1,952	0,00	0,000	4.267.596,07	1,952	0,00	0,000	4.267.596,07	1,952
PHP	4.583.039,45	2,097	26.736,47	0,012	4.556.302,99	2,084	0,00	0,000	4.556.302,99	2,084
PKR	1.513.064,66	0,692	0,00	0,000	1.513.064,66	0,692	0,00	0,000	1.513.064,66	0,692
PLN	6.158.203,06	2,817	0,00	0,000	6.158.203,06	2,817	0,00	0,000	6.158.203,06	2,817
PYG	1.259.524,56	0,576	0,00	0,000	1.259.524,56	0,576	0,00	0,000	1.259.524,56	0,576
RON	6.233.892,72	2,852	0,00	0,000	6.233.892,72	2,852	0,00	0,000	6.233.892,72	2,852
RSD	2.429.756,54	1,112	0,00	0,000	2.429.756,54	1,112	0,00	0,000	2.429.756,54	1,112
RUB	1.809.717,19	0,828	0,00	0,000	1.809.717,19	0,828	0,00	0,000	1.809.717,19	0,828
SEK	2.298.947,87	1,052	0,00	0,000	2.298.947,87	1,052	0,00	0,000	2.298.947,87	1,052
SGD	4.507.621,11	2,062	0,00	0,000	4.507.621,11	2,062	0,00	0,000	4.507.621,11	2,062
THB	1.430.727,04	0,655	735.072,88	0,336	695.654,16	0,318	0,00	0,000	695.654,16	0,318
TJS	825.521,14	0,378	0,00	0,000	825.521,14	0,378	0,00	0,000	825.521,14	0,378
TND	814.043,74	0,372	0,00	0,000	814.043,74	0,372	0,00	0,000	814.043,74	0,372
TRY	4.866.698,81	2,226	0,00	0,000	4.866.698,81	2,226	0,00	0,000	4.866.698,81	2,226
TWD	0,00	0,000	794.417,80	0,363	0,00	0,000	794.417,80	0,363	-794.417,80	-0,363
TZS	935.133,26	0,428	0,00	0,000	935.133,26	0,428	0,00	0,000	935.133,26	0,428
UAH	462.765,52	0,212	0,00	0,000	462.765,52	0,212	0,00	0,000	462.765,52	0,212
UGX	1.231.209,01	0,563	0,00	0,000	1.231.209,01	0,563	0,00	0,000	1.231.209,01	0,563
USD	36.760.406,80	16,817	17.568.244,44	8,037	19.192.162,36	8,780	0,00	0,000	19.192.162,36	8,780
UYU	5.929.506,74	2,713	0,00	0,000	5.929.506,74	2,713	0,00	0,000	5.929.506,74	2,713
UZS	5.365.739,16	2,455	0,00	0,000	5.365.739,16	2,455	0,00	0,000	5.365.739,16	2,455
VND	3.543.053,15	1,621	0,00	0,000	3.543.053,15	1,621	0,00	0,000	3.543.053,15	1,621
XOF	1.299.752,33	0,595	0,00	0,000	1.299.752,33	0,595	0,00	0,000	1.299.752,33	0,595
ZAR	7.835.136,08	3,584	0,00	0,000	7.835.136,08	3,584	0,00	0,000	7.835.136,08	3,584
ZMW	2.124.738,51	0,972	0,00	0,000	2.124.738,51	0,972	0,00	0,000	2.124.738,51	0,972
Total	242.514.474,86	110,944	31.160.152,67	14,255	223.762.237,16	102,365	12.407.914,97	5,676	211.354.322,19	96,689

Gliederung der Währungspositionen

Gliederung Gold und N.A.

Whg	Betrag (aktiv)	in %	Betrag (passiv)	in %	anzurechnender Betrag	in %
Total Gold und N.A.					0,00	0,000
Übertrag total Währungen (aktivistische Ausrichtung)					223.762.237,16	102,365
Währungsgesamtposition (aktivistische Ausrichtung)					223.762.237,16	102,365

N.A. = Nicht aufgliederbare Fondsanteile

CVA-Charge

Zuschlag CVA-Charge in % vom Fondsvermögen

0,01486

KSA-Risikogewichte nach Ländern

Fonds: 2496T2 Capitulum Weltzins-Invest Universal AK I
 Währung: EUR
 ISIN: DE000A2H7NU1
 LEI: 529900Q626RC55DLB570

Auswertung per: 21.10.2024 23:45
 Bewertungsdatum: 21.10.2024 23:45

Fondsvermögen

Fondsvermögen aus Solva: 218.592.281,23
 Fondsvermögen aus Bewertung: 218.592.281,23
 Differenz: 0,00

Durchschnittliche Gewichtungsziffer

Risikogewicht gemäß Art. 132 (7) CRR i.V.m. Art. 132c (1) CRR [= alternativer LTA]: 54,95%
 marktbewerteter risikogew. KSA-Positionswert gem. CRR 128.029.217,27

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	3.109.030,09	1,3344	1.554.515,05	0,6672	n/a
AT	Österreich	916.940,16	0,3935	916.940,16	0,3935	0,0000
AU	Australien	568.977,95	0,2442	568.977,95	0,2442	1,0000
BR	Brasilien	1.979.514,61	0,8496	1.438.516,27	0,6174	0,0000
CA	Canada	984.348,09	0,4225	984.348,09	0,4225	0,0000
CN	China	3.762.745,54	1,6149	3.762.745,54	1,6150	0,0000
CO	Kolumbien	571.997,35	0,2455	571.997,35	0,2455	n/a
CZ	Tschechische Republik	874.324,10	0,3753	874.324,10	0,3753	1,2500
DE	Bundesrep. Deutschland	5.175.121,53	2,2211	4.872.933,42	2,0914	0,7500
ES	Spanien	503.240,36	0,2160	754.860,54	0,3240	0,0000
FR	Frankreich	9.163.976,15	3,9331	5.945.828,69	2,5519	1,0000
GB	Großbritannien	10.125.173,22	4,3457	5.562.530,25	2,3874	2,0000
HU	Ungarn	350.470,74	0,1504	350.470,74	0,1504	0,5000
IL	Israel	469.608,96	0,2016	469.608,96	0,2016	n/a
IN	Indien	50.778,70	0,0218	76.168,05	0,0327	0,0000
IS	Island	471.330,11	0,2023	471.330,11	0,2023	2,5000
KZ	Kasachstan	3.789.182,57	1,6263	3.789.182,57	1,6263	n/a
LU	Luxemburg	849.073,54	0,3644	849.073,54	0,3644	0,5000
MX	Mexiko	3.256.360,23	1,3976	4.214.795,48	1,8090	0,0000
NL	Niederlande	5.910.935,49	2,5369	6.333.337,56	2,7182	2,0000
NO	Norwegen	1.956.187,12	0,8396	1.427.435,59	0,6127	2,5000
PA	Panama	389.701,25	0,1673	389.701,25	0,1673	n/a
PE	Peru	707.726,55	0,3038	707.726,55	0,3038	n/a
PL	Polen	12.469,75	0,0054	1.246,97	0,0005	0,0000
QA	Katar	3.243.390,88	1,3920	1.308.253,87	0,5615	n/a
RU	Rußland	2.235.034,17	0,9593	2.235.034,17	0,9593	0,0000
SE	Schweden	1.344.510,45	0,5771	1.344.510,45	0,5771	2,0000
SG	Singapur	627.599,05	0,2694	627.599,05	0,2694	0,0000
SNAT	SNAT	4.379.370,09	1,8796	3.474.963,61	1,4914	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>
US	USA	22.606.795,68	9,7027	13.583.387,29	5,8299	0,0000
UZ	Usbekistan	1.639.228,29	0,7035	1.639.228,29	0,7036	n/a
ZA	Südafrika	1.698.177,06	0,7288	2.314.198,89	0,9932	0,0000
Zwischensumme		93.723.319,78	40,2254	73.415.770,37	31,5096	
BF-Artikel 140 (4) CRD IV befreit		141.294.416,18	60,6427	54.612.493,94	23,4393	
Herkunftsland gem. Art. 2(5) a oder Art. 4(3) Del. VO (EU) 1152/2014		952,95	0,0004	952,95	0,0004	
Total		235.018.688,91	100,8685	128.029.217,27	54,9493	

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-249601	Sonstige Forderungen aus CSDR	952,95	0,0004	952,95	0,0004