

# Berechnung CVA



Fonds: 241KT1 Capitulum Sust. Local Currency Bond Fonds UI AK A  
 Währung: EUR  
 ISIN: DE000A2JF7Y2  
 LEI: 529900XCF0FCZ5HALF66  
 Fondsvermögen: 356.733.235,86  
 Anteile in Umlauf: 4.171.421

Auswertung per: 20.5.2026 23:45  
 Bewertungsdatum: 20.5.2026 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
871001	BNP Paribas S.A.	ROMUWSFPU8MPRO8K5F	2	5,00	2.225,73	1.238.468,74	3.715.406,22	1.446,72	1.446,72	0,00	0
<b>Total</b>								<b>1.446,72</b>	<b>1.446,72</b>	<b>0,00</b>	
									davon OTC:	63.891,44	0,02

Fondsvolumen inkl. Forderungen	356.733.235,86
- Fondsvolumen aus Bewertung	356.733.235,86
Differenz	0,00

	356.733.235,86	Default: Fondsvolumen aus Bewertung --> mit Buchwert überschreiben
	<b>Betrag in Buchwert:</b>	
	1.448,34	
	63.890,92	
	19.167,28	
	709.249,88	
<b>ZUSATZINFORMATIONEN:</b>		
CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten	0,00	Zeile 20; Spalte 70
Betrag Summe der Risikopositionswerte (OTC-Derivate mit CVA-Charge)	0,02	Zeile 20; Spalte 10
Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteausfallrisiko der OTC-Derivate mit CVA-Relevanz	0,01	Zeile 20; Spalte 20
Betrag Nominalbetrag CVA-Geschäfte	0,20	Zeile 20; Spalte 30
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 Gegenparteausfallrisiko	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 Gegenparteausfallrisiko der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mit CVA-Relevanz	0,00	Zeile 130; Spalte 20
Aggregation systematischer Komponenten des CVA-Risikos	0,00	Zeile 230; Spalte 70
Aggregation spezifischer Komponenten des CVA-Risikos	0,00	Zeile 240; Spalte 70