Berechnung CVA

Auswertung per: 20.11.2025 23:45 Bewertungsdatum: 20.11.2025 23:45

Fonds: 241KT1 Capitulum Sust. Local Currency Bond Fonds UI AK A

Währung:

ISIN:

DE000A2JF7Y2 529900XCF0FCZ5HALF66 344.174.927,81 4.172.308 LEI:

Fondsvermögen: Anteile in Umlauf:

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 - Ba unhedged BACVA	CVA-Risiko im Rahmen des sissansatzes - total BACVA	total BACVA in % FV	Zielfonds Anzahl Gegenparteien
871001	BNP Paribas S.A.	R0MUWSFPU8MPRO8K5P	2	5,00	8.707,63	18.955.722,06	56.867.166,17	5.659,96	5.659,96	0,00	0
Total								5.659,96	5.659,96	0,00	
								da	von OTC: 249.959,89	0,07	
Fondsvolumen inkl. Ford - Fondsvolumen aus Bew Differenz								344.174.927,81 344.174.927,81 0,00			
	CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten Betrag Summe der Risikopositionswerte (OTC-Derivate mit CVA-Charge) Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko der OTC-Derivate mit CVA-Relevanz Betrag Nominalbetrag CVA-Geschäfte					0,00 Zeile 0,07 Zeile 0,02 Zeile	mular C25.01 E e 20; Spalte 70 e 20; Spalte 10 e 20; Spalte 20 e 20; Spalte 30	344.174.927,81 dei Betrag in Buchwert: 5.661,68 249.960,48 74.152,49 2.850.911,06	fault: Marktwert des l	Fonds> mit Buc	chwert überschreiben
ZUSATZINFORMATIONEN: Gruppeninterne Geschäft: CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten Gruppeninterne Geschäft: Betrag Summe der Risikopositionswerte Gruppeninterne Geschäft: Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko					0,00 Zeile	e 40 u. 90; Spalte 70 e 40 u. 90; Spalte 10 e 40 u. 90; Spalte 20	-				
		Betrag Summe der Risikc Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteia	positionswerte (Wertpap		fte mit CVA-Charge)	0,00 Zeile	e 130; Spalte 70 e 130 Spalte 10 e 130; Soalte 20	-			