

# Berechnung CVA



Fonds: 241KT1 Capitulum Sust. Local Currency Bond Fonds UI AK A  
 Währung: EUR  
 ISIN: DE000A2JF7Y2  
 LEI: 529900XCF0FCZ5HALF66  
 Fondsvermögen: 354.551.186,55  
 Anteile in Umlauf: 4.147.336

Auswertung per: 20.4.2026 23:45  
 Bewertungsdatum: 20.4.2026 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	6.018,88	9.056.733,45	27.170.200,35	3.912,27	3.912,27	0,00	0	
<b>Total</b>								<b>3.912,27</b>	<b>3.912,27</b>	<b>0,00</b>		
								<b>davon OTC:</b>		172.777,01	0,05	
Fondsvolumen inkl. Forderungen								354.551.186,56				
- Fondsvolumen aus Bewertung								354.551.186,55				
Differenz								0,01				

	in %	Formular C25.01	Betrag in Buchwert:
CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten	0,00	Zeile 20; Spalte 70	3.910,70
Betrag Summe der Risikopositionswerte (OTC-Derivate mit CVA-Charge)	0,05	Zeile 20; Spalte 10	172.776,34
Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko der OTC-Derivate mit CVA-Relevanz	0,01	Zeile 20; Spalte 20	51.831,84
Betrag Nominalbetrag CVA-Geschäfte	0,41	Zeile 20; Spalte 30	1.440.527,29
<b>ZUSATZINFORMATIONEN:</b>			
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 Gegenparteiausfallrisiko	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 Gegenparteiausfallrisiko der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mit CVA-Relevanz	0,00	Zeile 130; Spalte 20	-
Aggregation systematischer Komponenten des CVA-Risikos	0,00	Zeile 230; Spalte 70	6.020,28
Aggregation spezifischer Komponenten des CVA-Risikos	0,00	Zeile 240; Spalte 70	6.020,28

354.551.186,55 Default: Fondsvolumen aus Bewertung --> mit Buchwert überschreiben