

Berechnung CVA



Fonds: 241KT1 Capitulum Sust. Local Currency Bond Fonds UI AK A
Währung: EUR
ISIN: DE000A2JF7Y2
LEI: 529900XCF0FCZ5HALF66
Fondsvermögen: 335.996.228,65
Anteile in Umlauf: 4.032.060

Auswertung per: 20.1.2026 23:45
Bewertungsdatum: 20.1.2026 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.	R0MUWSFPU8MPRO8K5P	2	5,00	10.825,18	29.296.154,56	87.888.463,69	7.036,37	7.036,37	0,00	0
Total								7.036,37	7.036,37	0,00	
									davon OTC:		
									310.745,94	0,09	

Fondsvolumen inkl. Forderungen	335.996.228,65
- Fondsvolumen aus Bewertung	335.996.228,65
Differenz	0,00

	335.996.228,65	default: Marktwert des Fonds --> mit Buchwert überschreiben
CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten	in % Formular C25.01	Betrag in Buchwert:
Betrag Summe der Risikopositionswerte (OTC-Derivate mit CVA-Charge)	0,00 Zeile 20; Spalte 70	7.035,76
Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko der OTC-Derivate mit CVA-Relevanz	0,09 Zeile 20; Spalte 10	310.746,11
Betrag Nominalbetrag CVA-Geschäfte	0,03 Zeile 20; Spalte 20	90.631,62
	0,84 Zeile 20; Spalte 30	2.820.006,27
ZUSATZINFORMATIONEN:		
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; Soalte 20	-