

Solva-Deckblatt



Fonds: 241KT1 Capitulum Sust. Local Currency Bond Fonds UI AK A
 Währung: EUR
 ISIN: DE000A2JF7Y2
 LEI: 529900XCF0FCZ5HALF66

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

Fondsvermögen
 Fondsvermögen aus Solva: 391.009.084,10
 Fondsvermögen aus Bewertung: 391.009.084,08
 Differenz: 0,02
Anteile in Umlauf: 4.743.954,06

Währungsgesamtposition (aktivische Ausrichtung)

Währung	384.864.254,62	98,428%
Gold		0,000%
N.A.		0,000%
Total	384.864.254,62	98,428%

Durchschnittliche Gewichtungsziffer
 Durchschn. Gew. Ziffer 20,42%
marktbewerteter risikogew. KSA-Positionswert gem. CRR 79.859.543,55

Risikogewicht gemäß Art. 132 (7) CRR i.V.m. Art. 132c (1) CRR [= alternativer LTA]:	20,424%
wobei:	
risikogewichteter Positionswert gem. Art. 132a (1) CRR [=RWAE]:	79.859.543,55
Riskopositionswert [=E]	392.605.003,15
Bruttofondsvermögen [=A]	392.605.003,15
Nettofondsvermögen (abzgl. FK) [=EQ]	391.009.084,10

Gliederung der Währungspositionen

Whg	Betrag (aktiv)		Betrag (passiv)		aktivische Ausrichtung		passivische Ausrichtung		Nettoposition	
	Betrag	in %	Betrag	in %	Betrag	in %	Betrag	in %	Betrag	in %
AMD	1.481.750,19	0,379	0,00	0,000	1.481.750,19	0,379	0,00	0,000	1.481.750,19	0,379
AOA	1.646.841,65	0,421	0,00	0,000	1.646.841,65	0,421	0,00	0,000	1.646.841,65	0,421
ARS	4.192.826,11	1,072	0,00	0,000	4.192.826,11	1,072	0,00	0,000	4.192.826,11	1,072
AUD	8.127.788,97	2,079	42.168,56	0,011	8.085.620,41	2,068	0,00	0,000	8.085.620,41	2,068
AZN	3.412.968,13	0,873	0,00	0,000	3.412.968,13	0,873	0,00	0,000	3.412.968,13	0,873
BDT	4.259.949,89	1,089	0,00	0,000	4.259.949,89	1,089	0,00	0,000	4.259.949,89	1,089
BRL	12.252.240,18	3,133	0,00	0,000	12.252.240,18	3,133	0,00	0,000	12.252.240,18	3,133
BWP	813.661,22	0,208	0,00	0,000	813.661,22	0,208	0,00	0,000	813.661,22	0,208
CAD	3.797.406,70	0,971	0,00	0,000	3.797.406,70	0,971	0,00	0,000	3.797.406,70	0,971
CHF	6.626.022,12	1,695	0,00	0,000	6.626.022,12	1,695	0,00	0,000	6.626.022,12	1,695
CLP	5.923.407,65	1,515	0,00	0,000	5.923.407,65	1,515	0,00	0,000	5.923.407,65	1,515
CNY	4.151.066,61	1,062	0,00	0,000	4.151.066,61	1,062	0,00	0,000	4.151.066,61	1,062
COP	11.486.398,08	2,938	0,00	0,000	11.486.398,08	2,938	0,00	0,000	11.486.398,08	2,938
CRC	4.617.168,42	1,181	0,00	0,000	4.617.168,42	1,181	0,00	0,000	4.617.168,42	1,181
CZK	8.517.783,24	2,178	0,00	0,000	8.517.783,24	2,178	0,00	0,000	8.517.783,24	2,178
DKK	10,14	0,000	0,00	0,000	10,14	0,000	0,00	0,000	10,14	0,000
DOP	12.104.914,24	3,096	0,00	0,000	12.104.914,24	3,096	0,00	0,000	12.104.914,24	3,096
EGP	6.588.038,42	1,685	0,00	0,000	6.588.038,42	1,685	0,00	0,000	6.588.038,42	1,685
GBP	7.494.984,73	1,917	0,00	0,000	7.494.984,73	1,917	0,00	0,000	7.494.984,73	1,917
GEL	2.835.046,53	0,725	0,00	0,000	2.835.046,53	0,725	0,00	0,000	2.835.046,53	0,725
GHS	3.749.614,76	0,959	0,00	0,000	3.749.614,76	0,959	0,00	0,000	3.749.614,76	0,959
GTQ	990.556,67	0,253	0,00	0,000	990.556,67	0,253	0,00	0,000	990.556,67	0,253
HKD	1.289,05	0,000	0,00	0,000	1.289,05	0,000	0,00	0,000	1.289,05	0,000

Gliederung der Währungspositionen

HUF	11.032.060,13	2,821	406,26	0,000	11.031.653,87	2,821	0,00	0,000	11.031.653,87	2,821
IDR	12.275.920,23	3,140	0,00	0,000	12.275.920,23	3,140	0,00	0,000	12.275.920,23	3,140
ILS	1.363,05	0,000	0,00	0,000	1.363,05	0,000	0,00	0,000	1.363,05	0,000
INR	13.705.917,46	3,505	0,00	0,000	13.705.917,46	3,505	0,00	0,000	13.705.917,46	3,505
ISK	2.120.914,16	0,542	0,00	0,000	2.120.914,16	0,542	0,00	0,000	2.120.914,16	0,542
JMD	3.605.471,70	0,922	0,00	0,000	3.605.471,70	0,922	0,00	0,000	3.605.471,70	0,922
JPY	4.219.729,76	1,079	0,00	0,000	4.219.729,76	1,079	0,00	0,000	4.219.729,76	1,079
KES	3.935.296,26	1,006	0,00	0,000	3.935.296,26	1,006	0,00	0,000	3.935.296,26	1,006
KRW	3.997.225,32	1,022	0,00	0,000	3.997.225,32	1,022	0,00	0,000	3.997.225,32	1,022
KZT	10.309.198,46	2,637	0,00	0,000	10.309.198,46	2,637	0,00	0,000	10.309.198,46	2,637
LKR	832.081,88	0,213	0,00	0,000	832.081,88	0,213	0,00	0,000	832.081,88	0,213
MNT	3.822.909,09	0,978	0,00	0,000	3.822.909,09	0,978	0,00	0,000	3.822.909,09	0,978
MXN	11.262.373,84	2,880	0,00	0,000	11.262.373,84	2,880	0,00	0,000	11.262.373,84	2,880
MYR	7.792.952,07	1,993	0,00	0,000	7.792.952,07	1,993	0,00	0,000	7.792.952,07	1,993
NGN	4.176.717,97	1,068	0,00	0,000	4.176.717,97	1,068	0,00	0,000	4.176.717,97	1,068
NOK	6.084.047,14	1,556	0,00	0,000	6.084.047,14	1,556	0,00	0,000	6.084.047,14	1,556
NZD	8.028.094,75	2,053	0,00	0,000	8.028.094,75	2,053	0,00	0,000	8.028.094,75	2,053
PEN	8.520.931,24	2,179	0,00	0,000	8.520.931,24	2,179	0,00	0,000	8.520.931,24	2,179
PHP	7.613.395,40	1,947	117.526,48	0,030	7.495.868,92	1,917	0,00	0,000	7.495.868,92	1,917
PKR	2.411.153,03	0,617	0,00	0,000	2.411.153,03	0,617	0,00	0,000	2.411.153,03	0,617
PLN	11.631.137,26	2,975	0,00	0,000	11.631.137,26	2,975	0,00	0,000	11.631.137,26	2,975
PYG	1.105.887,97	0,283	0,00	0,000	1.105.887,97	0,283	0,00	0,000	1.105.887,97	0,283
RON	11.498.785,60	2,941	0,00	0,000	11.498.785,60	2,941	0,00	0,000	11.498.785,60	2,941
RSD	1.951.764,33	0,499	0,00	0,000	1.951.764,33	0,499	0,00	0,000	1.951.764,33	0,499
RUB	6.101.803,29	1,561	0,00	0,000	6.101.803,29	1,561	0,00	0,000	6.101.803,29	1,561
SEK	3.487.986,48	0,892	0,00	0,000	3.487.986,48	0,892	0,00	0,000	3.487.986,48	0,892
SGD	5.525.196,54	1,413	0,00	0,000	5.525.196,54	1,413	0,00	0,000	5.525.196,54	1,413
THB	3.355.525,19	0,858	0,00	0,000	3.355.525,19	0,858	0,00	0,000	3.355.525,19	0,858
TND	1.195.888,48	0,306	0,00	0,000	1.195.888,48	0,306	0,00	0,000	1.195.888,48	0,306
TRY	8.337.321,77	2,132	0,00	0,000	8.337.321,77	2,132	0,00	0,000	8.337.321,77	2,132
TZS	1.445.488,84	0,370	0,00	0,000	1.445.488,84	0,370	0,00	0,000	1.445.488,84	0,370
UAH	758.163,54	0,194	0,00	0,000	758.163,54	0,194	0,00	0,000	758.163,54	0,194
UGX	3.118.004,47	0,797	0,00	0,000	3.118.004,47	0,797	0,00	0,000	3.118.004,47	0,797
USD	44.016.345,13	11,257	953.007,45	0,244	43.063.337,68	11,013	0,00	0,000	43.063.337,68	11,013
UYU	12.388.836,24	3,168	0,00	0,000	12.388.836,24	3,168	0,00	0,000	12.388.836,24	3,168
UZS	7.053.359,65	1,804	0,00	0,000	7.053.359,65	1,804	0,00	0,000	7.053.359,65	1,804
VND	5.929.763,58	1,517	0,00	0,000	5.929.763,58	1,517	0,00	0,000	5.929.763,58	1,517
XOF	764.287,75	0,195	0,00	0,000	764.287,75	0,195	0,00	0,000	764.287,75	0,195
ZAR	12.712.465,50	3,251	0,00	0,000	12.712.465,50	3,251	0,00	0,000	12.712.465,50	3,251
ZMW	2.779.865,12	0,711	0,00	0,000	2.779.865,12	0,711	0,00	0,000	2.779.865,12	0,711
Total	385.977.363,36	98,713	1.113.108,75	0,285	384.864.254,62	98,428	0,00	0,000	384.864.254,62	98,428

Gliederung Gold und N.A.

Whg	Betrag (aktiv)	in %	Betrag (passiv)	in %	anzurechnender Betrag	in %
-----	----------------	------	-----------------	------	-----------------------	------

Gliederung der Währungspositionen**Total Gold und N.A.****0,00****0,000****Übertrag total Währungen
(aktivische Ausrichtung)****384.864.254,62****98,428****Währungsgesamtposition
(aktivische Ausrichtung)****384.864.254,62****98,428**

N.A. = Nicht aufgliederbare Fondsanteile

CVA-Charge

Zuschlag CVA-Charge in % vom Fondsvermögen

0,00000

KSA-Risikogewichte nach Ländern

Fonds: 241KT1 Capitulum Sust. Local Currency Bond Fonds UI AK A
 Währung: EUR
 ISIN: DE000A2JF7Y2
 LEI: 529900XCF0FCZ5HALF66

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

Fondsvermögen

Fondsvermögen aus Solva: 391.009.084,10
 Fondsvermögen aus Bewertung: 391.009.084,08
 Differenz: 0,02

Durchschnittliche Gewichtungsziffer

Risikogewicht gemäß Art. 132 (7) CRR i.V.m. Art. 132c (1) CRR [= alternativer LTA]: 20,42%
 marktbewerteter risikogew. KSA-Positionswert gem. CRR 79.859.543,55

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>
BR	Brasilien	1.192.147,88	0,3049	238.429,58	0,0610	0,0000
FR	Frankreich	11.206.305,65	2,8660	5.603.152,83	1,4330	1,0000
GB	Großbritannien	7.897.394,75	2,0197	3.948.697,37	1,0099	2,0000
NL	Niederlande	852.345,40	0,2180	426.172,70	0,1090	2,0000
NO	Norwegen	786.348,74	0,2011	393.174,37	0,1006	2,5000
NZ	Neuseeland	3.528.504,63	0,9024	705.700,93	0,1805	n/a
SE	Schweden	1.110.519,77	0,2840	1.110.519,77	0,2840	2,0000
SG	Singapur	5.501.568,00	1,4070	1.100.313,60	0,2814	0,0000
SNAT	SNAT	4.324.380,71	1,1060	3.903.826,74	0,9984	n/a
US	USA	23.738.405,48	6,0711	12.218.544,18	3,1249	0,0000
Zwischensumme		60.137.921,01	15,3802	29.648.532,06	7,5826	
BF-Artikel 140 (4) CRD IV befreit		332.466.203,85	85,0277	50.210.133,21	12,8412	
Herkunftsland gem. Art. 2(5) a oder Art. 4(3) Del. VO (EU) 1152/2014		878,28	0,0002	878,28	0,0002	
Total		392.605.003,15	100,4082	79.859.543,55	20,4240	

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-241K01	Sonstige Forderungen aus CSDR	878,28	0,0002	878,28	0,0002