

Berechnung CVA



Fonds: 241KT2 Capitulum Sust. Local Currency Bond Fonds UI AK T
 Währung: EUR
 ISIN: DE000A2JF7Z9
 LEI: 529900XCF0FCZ5HALF66
 Fondsvermögen: 116.129.835,67
 Anteile in Umlauf: 904.570

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	1.971,45	971.656,23	2.914.968,68	1.281,44	1.281,44	0,00	0
Total								1.281,44	1.281,44	0,00	
									davon OTC:	56.592,19	0,05

Fondsvolumen inkl. Forderungen 116.129.835,68
 - Fondsvolumen aus Bewertung 116.129.835,67
 Differenz 0,01

	in %	Formular C25.01	Betrag in Buchwert:
CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten	0,00	Zeile 20; Spalte 70	1.280,91
Betrag Summe der Risikopositionswerte (OTC-Derivate mit CVA-Charge)	0,05	Zeile 20; Spalte 10	56.592,39
Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteausfallrisiko der OTC-Derivate mit CVA-Relevanz	0,01	Zeile 20; Spalte 20	16.978,18
Betrag Nominalbetrag CVA-Geschäfte	0,41	Zeile 20; Spalte 30	471.836,68
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 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	1.971,88
Aggregation spezifischer Komponenten des CVA-Risikos	0,00	Zeile 240; Spalte 70	1.971,88

116.129.835,67 Default: Fondsvolumen aus Bewertung --> mit Buchwert überschreiben