

Berechnung CVA

Fonds: 241KT2 Capitulum Sust. Local Currency Bond Fonds UI AK T
 Währung: EUR
 ISIN: DE000A2JF7Z9
 LEI: 529900XCF0FCZ5HALF66
 Fondsvermögen: 112.437.938,57
 Anteile in Umlauf: 898.479

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	3.622,42	3.280.481,33	9.841.444,00	2.354,57	2.354,57	0,00	0
Total								2.354,57	2.354,57	0,00	
								davon OTC:			
								103.984,58		0,09	

Fondsvolumen inkl. Forderungen
 - Fondsvolumen aus Bewertung
 Differenz

112.437.938,57
 112.437.938,57
 -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

ZUSATZINFORMATIONEN:
 Gruppeninterne Geschäft: CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten
 Gruppeninterne Geschäft: Betrag Summe der Risikopositionswerte
 Gruppeninterne Geschäft: Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko

CVA-Risiko Betrag aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften
 Betrag Summe der Risikopositionswerte (Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mit CVA-Charge)
 Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mit CVA-Relevanz

in % **Formular C25.01**
 Betrag in Buchwert:
 0,00 Zeile 20; Spalte 70
 0,09 Zeile 20; Spalte 10
 0,03 Zeile 20; Spalte 20
 0,84 Zeile 20; Spalte 30

112.437.938,57 default: Marktwert des Fonds --> mit Buchwert überschreiben
 2.354,45
 103.984,85
 30.327,89
 943.655,64

0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 70
 0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 10
 0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 20

-
 -
 -

0,00 Zeile 130; Spalte 70
 0,00 Zeile 130 Spalte 10
 0,00 Zeile 130; Spalte 20

-
 -
 -