

Berechnung CVA



Fonds: 241KT2 Capitulum Sust. Local Currency Bond Fonds UI AK T
 Währung: EUR
 ISIN: DE000A2JF7Z9
 LEI: 529900XCFC0FCZ5HALF66
 Fondsvermögen: 119.239.079,21
 Anteile in Umlauf: 928.468

Auswertung per: 20.5.2026 23:45
 Bewertungsdatum: 20.5.2026 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	743,95	138.364,57	415.093,70	483,57	483,57	0,00	0	
Total								483,57	483,57	0,00		
								davon OTC:		21.355,64	0,02	

Fondsvolumen inkl. Forderungen 119.239.079,21
 - Fondsvolumen aus Bewertung 119.239.079,21
 Differenz -0,00

	in %	Formular C25.01	Betrag in Buchwert:
CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten	0,00	Zeile 20; Spalte 70	484,11
Betrag Summe der Risikopositionswerte (OTC-Derivate mit CVA-Charge)	0,02	Zeile 20; Spalte 10	21.355,72
Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko der OTC-Derivate mit CVA-Relevanz	0,01	Zeile 20; Spalte 20	6.406,72
Betrag Nominalbetrag CVA-Geschäfte	0,20	Zeile 20; Spalte 30	237.066,37
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; Spalte 20	-
Aggregation systematischer Komponenten des CVA-Risikos	0,00	Zeile 230; Spalte 70	744,05
Aggregation spezifischer Komponenten des CVA-Risikos	0,00	Zeile 240; Spalte 70	744,05

119.239.079,21 Default: Fondsvolumen aus Bewertung --> mit Buchwert überschreiben