Berechnung CVA



Auswertung per: 20.11.2025 23:45 Bewertungsdatum: 20.11.2025 23:45

241KT2 Capitulum Sust. Local Currency Bond Fonds UI AK T EUR DE000A2JF7Z9 529900XCF0FCZ5HALF66 108.888.267,40 878.985 Fonds: Währung:

ISIN:

LEI:

Fondsvermögen: Anteile in Umlauf:

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 - E 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	2.754,88	1.897.334,83	5.692.004,50	1.790,67	1.790,67	0,00	0
Total								1.790,67 d	1.790,67 avon OTC: 79.081.00	0,00	
Fondsvolumen inkl. Forde - Fondsvolumen aus Bewe Differenz								108.888.267,40 108.888.267,40 0,00			
	CVA-Risiko Betrag aus Betrag Summe der Risikopositionswerte (OTC-Derivate m Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko der OTC-Derivate mit Betrag Nominalbetrag (ate mit CVA-Charge) e mit CVA-Relevanz	0,00 Zeil 0,07 Zeil 0,02 Zeil	mular C25.01 E e 20; Spalte 70 e 20; Spalte 10 e 20; Spalte 20 e 20; Spalte 30	108.888.267,40 d Betrag in Buchwert:	efault: Marktwert des l	Fonds> mit Buc	hwert überschreiben	
		Gruppeninterne Geschä	Gruppeninterne Gesch	häft: CVA-Risiko Betrag äft: Betrag Summe der I	Risikopositionswerte	0,00 Zeil	e 40 u. 90; Spalte 70 e 40 u. 90; Spalte 10 e 40 u. 90; Spalte 20	-			
		Betrag Summe der Risiko Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiau	positionswerte (Wertpap		fte mit CVA-Charge)	0,00 Zeil	e 130; Spalte 70 e 130 Spalte 10 e 130; Soalte 20	-			