

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	112.437.938,57
- Fondsvolumen aus Bewertung	112.437.938,57
Differenz	-0,00

	112.437.938,57	default: Marktwert des Fonds --> mit Buchwert überschreiben
CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten	in % Formular C25.01	Betrag in Buchwert:
Betrag Summe der Risikopositionswerte (OTC-Derivate mit CVA-Charge)	0,00 Zeile 20; Spalte 70	2.354,45
Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko der OTC-Derivate mit CVA-Relevanz	0,09 Zeile 20; Spalte 10	103.984,85
Betrag Nominalbetrag CVA-Geschäfte	0,03 Zeile 20; Spalte 20	30.327,89
	0,84 Zeile 20; Spalte 30	943.655,64
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; Soalte 20	-