

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.01.2018
Sondervermögen: SEB ImmoInvest

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	Risikogewichteter SA-Positionswert
I. IMMOBILIEN		436.259.608,82	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%	436.259.608,82	436.259.608,82
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		202.103.174,32	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 CRR	100%	202.103.174,32	202.103.174,32
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		266.723.663,50	Institute, Art. 119 CRR	20%	266.723.663,50	53.344.732,70
2. Investmentanteile			OGA-Risikopositionen, Art. 132 CRR	100%	0,00	0,00
	Intransparenter Fonds	0,00				
	Transparenter Fonds					
	- SEB Immo Cash	0,00		0%	0,00	0,00
	- SEB Total Return Quant Fund	0,00		0%	0,00	0,00
	- SEB WP Direkt	21.940.465,91		89%	21.940.465,91	19.576.327,19
		21.940.465,91				
IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE						
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		19.418.940,81	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	19.418.940,81	19.418.940,81
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		151.201.352,04	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	151.201.352,04	151.201.352,04
3. Zinsansprüche aus befristeten Bankguthaben aus Wertpapieren		0,00	Institute, Art. 120 CRR	50%	0,00	0,00
		0,00		50%	0,00	0,00
4. Sonstige Forderungen						
a.) Anzahlungen auf noch nicht erworbene Objekte	- an Verkäufer	0,00	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	0,00	0,00
	- auf Notaranderkonto	0,00	Institute, Art. 120 CRR	50%	0,00	0,00
b.) Sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten		24.261.100,86	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	24.261.100,86	24.261.100,86
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		3.526.755,41	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	3.526.755,41	3.526.755,41
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer		5.236.380,16	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	5.236.380,16	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		12.826.705,98	Institute, Art. 119, 120 CRR			
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	11.723.351,95	2.344.670,39
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%	4.027.803,77	2.013.901,89

Bruttofondsvermögen

1.143.498.147,81

Summe risikogewichtete SA-Positionswerte

914.050.564,42

durchschnittliche Risikogewichtszahl

79,93%

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%	Land	Bruttofondsvermögen	Bemessungsgrundlage	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl
USD	172.495,84	0,02%	Niederlande	13.555.288,93	1,19%	8.562.659,46	0,75%
SEK	79.970,64	0,01%	Grossbritannien	1.497.340,86	0,13%	208.063,20	0,02%
CNY	0,00	0,00%	Belgien	5.357.044,65	0,47%	2.462.450,30	0,22%
JPY	2.225,82	0,00%	Luxemburg	68.363,59	0,01%	16.410,40	0,00%
SGD	-13.126,99	0,00%	Österreich	1.972.364,85	0,17%	1.274.173,02	0,11%
PLN	-365,88	0,00%	USA	262.167.126,61	22,93%	256.465.745,20	22,43%
GBP	-4.199,58	0,00%	Frankreich	118.512.178,45	10,36%	112.674.045,92	9,85%
HUF	0,00	0,00%	Italien	282.519.932,71	24,71%	274.627.287,85	24,02%
CZK	0,00	0,00%	Polen	26.483.508,56	2,32%	24.788.331,65	2,17%
			Japan	14.710.943,98	1,29%	14.290.558,35	1,25%
			Ungarn	31.920,00	0,00%	31.920,00	0,00%
			Singapur	4.445.187,20	0,39%	4.445.187,20	0,39%
			Finnland	6.203.083,96	0,54%	954.677,18	0,08%
			Deutschland	405.973.863,46	35,50%	213.249.054,70	18,65%
Fremdwährungsanteil gesamt		0,03%					