

## Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 28.02.2018  
Sondervermögen: SEB ImmoInvest

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	= Risikogewichteter SA-Positionswert
<b>I. IMMOBILIEN</b>		<b>431.909.154,16</b>	<b>Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR</b>	<b>100%</b>	<b>431.909.154,16</b>	<b>431.909.154,16</b>
<b>II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN</b>		<b>201.776.514,72</b>	<b>Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C</b>	<b>100%</b>	<b>201.776.514,72</b>	<b>201.776.514,72</b>
<b>III. LIQUIDITÄTSANLAGEN</b>						
1. Bankguthaben		269.543.756,61	Institute, Art. 119 CRR	20%	269.543.756,61	53.908.751,32
2. Investmentanteile	Intransparenter Fonds Transparenter Fonds - SEB Immo Cash - SEB Total Return Quant Fund - SEB WP Direkt	0,00 0,00 0,00 0,00 21.531.858,65	OGA-Risikopositionen, Art. 132 CRR	100% 0% 0% 90%	0,00 0,00 0,00 21.531.858,65	0,00 0,00 0,00 19.419.599,25
<b>IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE</b>						
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		19.949.179,79	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	19.949.179,79	19.949.179,79
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		153.912.158,85	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	153.912.158,85	153.912.158,85
3. Zinsansprüche aus befristeten Bankguthaben aus Wertpapieren		0,00 0,00	Institute, Art. 120 CRR	50% 50%	0,00 0,00	0,00 0,00
4. Sonstige Forderungen						
a.) Anzahlungen auf noch nicht erworbene Objekte	- an Verkäufer - auf Notaranderkonto	0,00 0,00	Unternehmen, Art. 122 CRR Institute, Art. 120 CRR	100% 50%	0,00 0,00	0,00 0,00
b.) Sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten		30.373.313,62	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	30.373.313,62	30.373.313,62
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		3.435.993,46	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	3.435.993,46	3.435.993,46
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer		5.390.261,23	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	5.390.261,23	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		5.175.697,56	Institute, Art. 119, 120 CRR Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate) Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20% 50%	6.864.723,45 1.254.403,29	1.372.944,69 627.201,64
<b>Bruttofondsvermögen</b>		<b>1.142.997.888,65</b>			<b>Summe risikogewichtete SA-Positionswerte</b>	<b>916.684.811,51</b>

**durchschnittliche Risikogewichtszahl 80,20%**

Fremdwährungsanteil			Land	Bruttofondsvermögen	Bemessungs-grundlage	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl	
		Ungesicherter Fremdwährungsanteil	Niederlande	NL	8.302.394,84	0,73%	3.283.943,14	0,29%
			Grossbritannien	GB	1.491.176,78	0,13%	207.203,74	0,02%
			Belgien	BE	5.358.739,35	0,47%	2.462.762,28	0,22%
			Luxemburg	LU	68.363,59	0,01%	16.410,40	0,00%
			Österreich	AT	1.217.880,96	0,11%	517.541,31	0,05%
			USA	US	260.740.813,58	22,81%	254.213.869,46	22,24%
			Frankreich	FR	118.629.043,54	10,38%	113.033.815,73	9,89%
			Italien	IT	281.299.653,04	24,81%	273.641.772,71	23,94%
			Polen	PL	28.671.300,43	2,51%	26.988.059,91	2,36%
			Japan	JP	15.227.648,69	1,33%	14.792.485,87	1,29%
			Ungarn	HU	31.920,00	0,00%	31.920,00	0,00%
			Singapur	SG	4.508.991,13	0,39%	4.508.991,13	0,39%
			Finnland	FI	7.524.534,41	0,66%	2.279.043,60	0,20%
			Deutschland	DE	409.925.428,31	35,86%	220.706.992,23	19,31%
		<b>Fremdwährungsanteil gesamt</b>					<b>0,01%</b>	