Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 30.04.2018
Sondervermögen: SEB ImmoInvest

			EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	= Risikogewichteter SA-Positionswert
I.	**IMMOBILIEN**			**399.707.579,02**	**Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR**	100%	399.707.579,02	399.707.579,02
II.	**BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN**			**197.265.775,98**	**Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 (**	100%	197.265.775,98	197.265.775,98
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**							
1.	Bankguthaben			**274.120.265,75**	**Institute, Art. 119 CRR**	20%	274.120.265,75	54.824.053,15
2.	Investmentanteile	Intransparenter Fonds	0,00		**OGA-Risikopositionen, Art. 132 CRR**	100%	0,00	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	20.780.669,46	**20.780.669,46**		52%	20.780.669,46	10.815.000,31
IV.	**SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE**							
1.	Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung			**25.759.194,56**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	25.759.194,56	25.759.194,56
2.	Forderungen an Immobilien-Gesellschaften			**155.613.197,76**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	155.613.197,76	155.613.197,76
3.	Zinsansprüche							
	aus befristeten Bankguthaben			**0,00**	**Institute, Art. 120 CRR**	50%	0,00	0,00
	aus Wertpapieren			**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		37.823.348,93		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	37.823.348,93	37.823.348,93
c.)	Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		1.854.945,75		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	1.854.945,75	1.854.945,75
d.)	Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer		2.208.122,70	**41.886.417,38**	**Zentralstaaten, Art. 114 CRR**	0%	2.208.122,70	0,00
5.	Ansprüche aus Derivatgeschäften			**910.919,71**	**Institute, Art. 119, 120 CRR**			
					Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	1.875.907,99	375.181,60
					Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%	1.810.125,11	905.062,56

Bruttofondsvermögen **1.116.044.019,62**

Summe risikogewichete SA-Positionswerte **884.943.339,62**

durchschnittliche Risikogewichtszahl **79,29%**

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	388.118,09	0,04%
SEK	0,00	0,00%
CNY	0,00	0,00%
JPY	-4.753,71	0,00%
SGD	31.047,94	0,00%
PLN	26.555,39	0,00%
GBP	-1.277,38	0,00%
HUF	0,00	0,00%
CZK	0,00	0,00%
Fremdwährungsanteil gesamt		**0,05%**

Land		Bruttofondsvermögen	Bemessungs-grundlage	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl
Niederlande	NL	829.977,54	**0,07%**	829.977,54	**0,07%**
Grossbritanien	GB	89.901,01	**0,01%**	799,16	**0,00%**
Belgien	BE	1.738.694,61	**0,16%**	1.738.694,61	**0,16%**
Luxemburg	LU	67.703,99	**0,01%**	0,00	**0,00%**
Österreich	AT	468.616,23	**0,04%**	468.616,23	**0,04%**
USA	US	255.167.951,96	**22,86%**	255.167.951,96	**22,86%**
Frankreich	FR	113.855.893,07	**10,20%**	112.046.229,43	**10,04%**
Italien	IT	245.205.396,45	**21,97%**	245.205.396,45	**21,97%**
Polen	PL	26.535.639,73	**2,38%**	26.526.435,79	**2,38%**
Japan	JP	14.526.687,64	**1,30%**	14.526.687,64	**1,30%**
Ungarn	HU	1.920,00	**0,00%**	1.920,00	**0,00%**
Singapur	SG	0,00	**0,00%**	0,00	**0,00%**
Finnland	FI	1.259.050,90	**0,11%**	1.026.601,62	**0,09%**
Deutschland	DE	182.176.320,74	**16,32%**	172.579.976,04	**15,46%**
Privilegierte Forderungsklasse (Bankguthaben)		274.120.265,75	**24,56%**	54.824.053,15	**4,91%**