Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.05.2018
Sondervermögen: SEB ImmoInvest

				EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X	Positionswert	=	Risikogewichteter SA-Positionswert
I.	**IMMOBILIEN**				**401.717.390,19**	**Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR**	100%		401.717.390,19		401.717.390,19
II.	**BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN**				**184.318.925,47**	**Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C**	100%		184.318.925,47		184.318.925,47
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**										
1.	Bankguthaben				**275.273.166,31**	**Institute, Art. 119 CRR**	20%		275.273.166,31		55.054.633,26
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		20.424.796,81	**20.424.796,81**		52%		20.424.796,81		10.714.172,48
IV.	**SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE**										
1.	Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung				**24.450.301,40**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		24.450.301,40		24.450.301,40
2.	Forderungen an Immobilien-Gesellschaften				**160.977.995,23**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		160.977.995,23		160.977.995,23
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			41.405.716,11		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		41.405.716,11		41.405.716,11
c.)	Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter			2.012.509,71		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		2.012.509,71		2.012.509,71
d.)	Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer			10.843.944,19	**54.262.170,01**	**Zentralstaaten, Art. 114 CRR**	0%		10.843.944,19		0,00
5.	Ansprüche aus Derivatgeschäften				**33.548,79**	**Institute, Art. 119, 120 CRR**					
						Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%		646.959,43		129.391,89
						Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%		2.116.882,77		1.058.441,38
Bruttofondsvermögen					**1.121.458.294,21**				**Summe risikogewichete SA-Positionswerte**		**881.839.477,12**

durchschnittliche Risikogewichtszahl **78,63%**

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	279.857,95	0,03%
SEK	0,00	0,00%
CNY	0,00	0,00%
JPY	-1.169,69	0,00%
SGD	30.286,17	0,00%
PLN	25.970,99	0,00%
GBP	-1.282,63	0,00%
HUF	0,00	0,00%
CZK	0,00	0,00%
Fremdwährungsanteil gesamt		**0,03%**

Land		Bruttofondsvermögen	Bemessungs-grundlage	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl
Niederlande	NL	829.977,53	**0,07%**	829.977,53	**0,07%**
Grossbritanien	GB	90.249,16	**0,01%**	802,42	**0,00%**
Belgien	BE	1.738.657,31	**0,16%**	1.738.657,31	**0,16%**
Luxemburg	LU	67.703,99	**0,01%**	0,00	**0,00%**
Österreich	AT	457.366,23	**0,04%**	457.366,23	**0,04%**
USA	US	262.554.567,42	**23,41%**	262.554.567,42	**23,41%**
Frankreich	FR	122.432.031,68	**10,92%**	111.986.921,69	**9,99%**
Italien	IT	245.205.396,45	**21,86%**	245.205.396,45	**21,86%**
Polen	PL	26.535.194,21	**2,37%**	26.525.960,02	**2,37%**
Japan	JP	931.598,03	**0,08%**	931.598,03	**0,08%**
Ungarn	HU	1.920,00	**0,00%**	1.920,00	**0,00%**
Singapur	SG	0,00	**0,00%**	0,00	**0,00%**
Finnland	FI	1.258.232,50	**0,11%**	1.025.783,22	**0,09%**
Deutschland	DE	184.082.233,39	**16,41%**	175.525.893,54	**15,65%**
Privilegierte Forderungsklasse (Bankguthaben)		275.273.166,31	**24,55%**	55.054.633,26	**4,91%**