

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.07.2018
Sondervermögen: SEB ImmoInvest

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	= Risikogewichteter SA-Positionswert
I. IMMOBILIEN		340.300.000,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%	340.300.000,00	340.300.000,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		245.138.035,27	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C	100%	245.138.035,27	245.138.035,27
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		145.461.984,05	Institute, Art. 119 CRR	20%	145.461.984,05	29.092.396,81
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	19.714.630,61		47%	19.714.630,61	9.285.931,91
IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE						
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		22.398.138,24	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	22.398.138,24	22.398.138,24
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		160.322.390,12	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	160.322.390,12	160.322.390,12
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.) Margin Account Devisentermingeschäfte	Kontrahent KI	39.232.614,05	Institute, Art. 120 CRR	50%	39.232.614,05	19.616.307,03
b.) Sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten		2.101.331,11	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	2.101.331,11	2.101.331,11
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		2.201.345,08	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	2.201.345,08	2.201.345,08
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer		10.863.476,21	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	10.863.476,21	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		24.031,64	Institute, Art. 119, 120 CRR			
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	535.873,70	107.174,74
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%	1.989.599,64	994.779,82

Bruttofondsvermögen

987.757.976,38

Summe risikogewichtete SA-Positionswerte

831.557.830,12

durchschnittliche Risikogewichtszahl

84,19%

Fremdwährungsanteil

	Land	Bruttofondsvermögen	Bemessungs-grundlage	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl
	Niederlande	NL	857.335,54	0,09%	0,09%
	Grossbritannien	GB	788,79	0,00%	0,00%
	Belgien	BE	57.344,91	0,01%	0,01%
	Luxemburg	LU	0,00	0,00%	0,00%
	Österreich	AT	484.298,27	0,05%	0,05%
	USA	US	260.786.512,88	26,40%	26,40%
	Frankreich	FR	111.882.216,43	11,33%	11,33%
	Italien	IT	244.234.085,75	24,73%	24,73%
	Polen	PL	26.596.275,58	2,69%	2,69%
	Japan	JP	903.295,81	0,09%	0,09%
	Ungarn	HU	1.920,00	0,00%	0,00%
	Singapur	SG	-0,01	0,00%	0,00%
	Finnland	FI	1.025.783,22	0,10%	0,10%
	Deutschland	DE	145.346.013,26	14,71%	13,66%
	Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)		195.582.105,95	19,80%	5,04%

Ungesicherter Fremdwährungsanteil

Währung	EUR	%
USD	399.687,41	0,05%
SEK	0,00	0,00%
CNY	0,00	0,00%
JPY	-1.622,99	0,00%
SGD	29.654,91	0,00%
PLN	26.140,39	0,00%
GBP	-18.415,54	0,00%
HUF	0,00	0,00%
CZK	0,00	0,00%
Fremdwährungsanteil gesamt		0,05%