

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 30.09.2018
Sondervermögen: SEB ImmoInvest

			<u>Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR</u>	Risikogewicht	X Positionswert	Risikogewichteter SA-Positionswert =
	EUR	EUR				Positionswert
I. IMMOBILIEN		336.800.000,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%	336.800.000,00	336.800.000,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		245.949.009,14	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C	100%	245.949.009,14	245.949.009,14
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		146.843.423,76	Institute, Art. 119 CRR	20%	146.843.423,76	29.368.684,75
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	18.832.846,45		43%	18.832.846,45	8.171.748,91
IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE						
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		18.098.260,76	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	18.098.260,76	18.098.260,76
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		158.819.518,67	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	158.819.518,67	158.819.518,67
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	42.302.614,05	Institute, Art. 120 CRR	50%	42.302.614,05	21.151.307,03
b.) Sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten		4.269.523,19	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	4.269.523,19	4.269.523,19
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		3.327.879,02	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	3.327.879,02	3.327.879,02
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer		10.856.835,50	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	10.856.835,50	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		8.188,38	Institute, Art. 119, 120 CRR			
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	594.459,43	118.891,89
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%	1.962.649,04	981.324,52
Bruttofondsvermögen		986.108.098,92			Summe risikogewichtete SA-Positionswerte	827.056.147,88

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % 83,87

Fremdwährungsanteil				Land	Bruttofondsvermögen	Bemessungsgrundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %	
Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil	EUR	%						
USD	369.655,65		0,0427	Niederlande	NL	857.335,54	0,09	857.335,54	0,09
SEK	0,00		0,0000	Grossbritannien	GB	0,00	0,00	0,00	0,00
CNY	0,00		0,0000	Belgien	BE	57.271,51	0,01	57.271,51	0,01
JPY	-15.991,66		0,0018	Luxemburg	LU	0,00	0,00	0,00	0,00
SGD	238,62		0,0000	Österreich	AT	461.934,08	0,05	461.934,08	0,05
PLN	26.121,66		0,0030	USA	US	264.973.112,76	26,87	264.973.112,76	26,87
GBP	-20.995,78		0,0024	Frankreich	FR	112.103.697,65	11,37	112.103.697,65	11,37
HUF	0,00		0,0000	Italien	IT	241.539.204,05	24,49	241.539.204,05	24,49
CZK	0,00		0,0000	Polen	PL	26.607.407,08	2,70	26.607.407,08	2,70
				Japan	JP	884.898,25	0,09	884.898,25	0,09
				Ungarn	HU	1.920,00	0,00	1.920,00	0,00
				Singapur	SG	0,00	0,00	0,00	0,00
				Finnland	FI	1.025.783,22	0,10	1.025.783,22	0,10
				Deutschland	DE	137.584.473,09	13,95	126.923.375,55	12,87
Fremdwährungsanteil gesamt			0,0500	Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)		200.011.061,69	20,28	51.620.208,18	5,23