

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 30.11.2018
Sondervermögen: SEB ImmoInvest

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	Risikogewichteter SA-Positionswert
I. IMMOBILIEN		325.960.000,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%	325.960.000,00	325.960.000,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		248.711.246,07	Beteiligungsriskopositionen Art. 133 CI	100%	248.711.246,07	248.711.246,07
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		164.938.995,96	Institute, Art. 119 CRR	20%	164.938.995,96	32.987.799,19
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	OGA-Risikopositionen, Art. 132 CRR	100% 0% 0% 0%	0,00 0,00 0,00 0,00	0,00 0,00 0,00 0,00
		<u>0,00</u>			<u>0,00</u>	<u>0,00</u>
IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE						
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		15.287.301,63	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	15.287.301,63	15.287.301,63
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		161.812.690,51	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	161.812.690,51	161.812.690,51
3. Zinsansprüche aus befristeten Bankguthaben aus Wertpapieren		6.025,53 0,00	Institute, Art. 120 CRR	50% 50%	6.025,53 0,00	3.012,77 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		1.519.015,12	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	1.519.015,12	1.519.015,12
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		5.339.124,40	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	5.339.124,40	5.339.124,40
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer		10.889.190,16	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	10.889.190,16	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		338.769,62	Institute, Art. 119, 120 CRR			
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	541.208,95	108.241,79
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%	2.447.252,14	1.223.626,07
Bruttovermögen		977.104.973,05				814.103.364,57

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % 83,32

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil	
	EUR	%
USD	368.550,39	0,0428
SEK	0,00	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	-80,46	0,0000
SGD	154,71	0,0000
PLN	-4.298,98	0,0005
GBP	-23.374,98	0,0027
HUF	0,00	0,0000
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		0,0461

Land	Bruttovermögen	Bemessungs-grundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
Niederlande	913.751,23	0,09	913.751,23	0,09
Grossbritannien	0,00	0,00	0,00	0,00
Belgien	57.198,11	0,01	57.198,11	0,01
Luxemburg	0,00	0,00	0,00	0,00
Österreich	461.934,08	0,05	461.934,08	0,05
USA	270.109.759,88	27,64	270.109.759,88	27,64
Frankreich	111.845.664,81	11,45	111.845.664,81	11,45
Italien	240.924.432,80	24,66	240.924.432,80	24,66
Polen	26.965.312,05	2,76	26.965.312,05	2,76
Japan	905.611,43	0,09	905.611,43	0,09
Ungarn	1.920,00	0,00	1.920,00	0,00
Singapur	0,01	0,00	0,01	0,00
Finnland	1.025.783,22	0,10	1.025.783,22	0,10
Deutschland	105.424.035,64	10,79	105.421.022,88	10,79
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)	218.469.569,79	22,36	55.470.974,08	5,68