

**Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)**

Datum: **31.01.2019**  
 Sondervermögen: **SEB ImmoInvest**

				<u>Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR</u>	Risikogewicht	X Positionswert	Risikogewichteter SA-Positionswert
		EUR	EUR				=
<b>I. IMMOBILIEN</b>			<b>87.360.000,00</b>	<b>Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR</b>	100%	87.360.000,00	87.360.000,00
<b>II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN</b>			<b>224.700.216,60</b>	<b>Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 CRR</b>	100%	224.700.216,60	224.700.216,60
<b>III. LIQUIDITÄTSANLAGEN</b>							
1.	Bankguthaben		<b>173.235.310,17</b>	<b>Institute, Art. 119 CRR</b>	20%	173.235.310,17	34.647.062,03
2.	Investmentanteile	Intransparenter Fonds	0,00	<b>OGA-Risikopositionen, Art. 132 CRR</b>	100%	0,00	0,00
		Transparenter Fonds			0%	0,00	0,00
		- 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	<u>0,00</u>		0%	0,00	0,00
<b>IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE</b>							
1.	Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		<b>14.238.035,37</b>	<b>Unternehmen, Art. 122 CRR</b>	100%	14.238.035,37	14.238.035,37
2.	Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		<b>158.017.365,02</b>	<b>Unternehmen, Art. 122 CRR</b>	100%	158.017.365,02	158.017.365,02
3.	Zinsansprüche aus befristeten Bankguthaben aus Wertpapieren		<b>0,00</b>	<b>Institute, Art. 120 CRR</b>	50%	0,00	0,00
			<b>0,00</b>		50%	0,00	0,00
4.	Sonstige Forderungen						
a.)	Margin Account Devisentermingeschäfte	Kontrahent KI	42.302.614,05	<b>Institute, Art. 120 CRR</b>	50%	42.302.614,05	21.151.307,03
b.)	Sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten		167.396.453,19	<b>Unternehmen, Art. 122 CRR</b>	100%	167.396.453,19	167.396.453,19
c.)	Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		4.911.784,17	<b>Unternehmen, Art. 122 CRR</b>	100%	4.911.784,17	4.911.784,17
d.)	Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer		<u>2.362.881,73</u>	<b>Zentralstaaten, Art. 114 CRR</b>	0%	2.362.881,73	0,00
5.	Ansprüche aus Derivatgeschäften		<b>916.227,99</b>	<b>Institute, Art. 119, 120 CRR</b>			
				Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	534.632,78	106.926,56
				Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%	2.759.614,62	1.379.807,31
<b>Bruttofondsvermögen</b>			<b><u>875.440.888,29</u></b>	<b>Summe risikogewichete SA-Positionswerte</b>			<b><u>713.908.957,27</u></b>

**durchschnittliche Risikogewichtszahl in %** **81,55**

				Land	Bruttofondsvermögen	Bemessungs-grundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %	
<b>Fremdwährungsanteil</b>				<b>Niederlande</b>	NL	901.825,38	0,10	901.825,38	0,10
				<b>Grossbritannien</b>	GB	0,00	0,00	0,00	0,00
				<b>Belgien</b>	BE	57.123,51	0,01	57.123,51	0,01
				<b>Luxemburg</b>	LU	0,00	0,00	0,00	0,00
				<b>Österreich</b>	AT	461.934,08	0,05	461.934,08	0,05
				<b>USA</b>	US	242.777.690,36	27,73	242.777.690,36	27,73
				<b>Frankreich</b>	FR	111.650.444,35	12,75	111.650.444,35	12,75
				<b>Italien</b>	IT	166.268.186,59	18,99	166.268.186,59	18,99
				<b>Polen</b>	PL	27.015.131,31	3,09	27.015.131,31	3,09
				<b>Japan</b>	JP	0,00	0,00	0,00	0,00
				<b>Ungarn</b>	HU	1.920,00	0,00	1.920,00	0,00
				<b>Singapur</b>	SG	0,00	0,00	0,00	0,00
				<b>Finnland</b>	FI	1.025.783,22	0,12	1.025.783,22	0,12
				<b>Deutschland</b>	DE	106.463.815,55	12,16	106.463.815,55	12,16
<b>Fremdwährungsanteil gesamt</b>				<b>Privilegierte Forderungsklasse</b>		218.817.033,94	25,00	57.285.102,92	6,54
				(Institute, Zentralstaaten)					
<b>Ungesicherter Fremdwährungsanteil</b>		<b>EUR</b>	<b>%</b>						
USD		539.516,73	0,0684						
SEK		0,00	0,0000						
CNY		0,00	0,0000						
JPY		5.188,87	0,0007						
SGD		617,21	0,0001						
PLN		-107,56	0,0000						
GBP		5.993,67	0,0008						
HUF		0,00	0,0000						
CZK		0,00	0,0000						
<b>Fremdwährungsanteil gesamt</b>		<b><u>0,0699</u></b>							