Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 30.06.2019
Sondervermögen: SEB ImmoInvest

				EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	= Risikogewichteter SA-Positionswert
I.	**IMMOBILIEN**				**75.560.000,00**	**Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR**	100%	75.560.000,00	75.560.000,00
II.	**BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN**				**227.215.000,07**	**Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 CRR**	100%	227.215.000,07	227.215.000,07
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**								
1.	Bankguthaben				**216.284.916,84**	**Institute, Art. 119 CRR**	20%	216.284.916,84	43.256.983,37
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		0,00	**0,00**		0%	0,00	0,00
IV.	**SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE**								
1.	Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung				**12.922.775,40**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	12.922.775,40	12.922.775,40
2.	Forderungen an Immobilien-Gesellschaften				**153.896.833,45**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	153.896.833,45	153.896.833,45
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.)	Margin Account Devisentermingeschäfte	Kontrahent KI		10.010.000,00		**Institute, Art. 120 CRR**	50%	10.010.000,00	5.005.000,00
b.)	Sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten			150.726.291,44		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	150.726.291,44	150.726.291,44
c.)	Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter			7.227.577,37		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	7.227.577,37	7.227.577,37
d.)	Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer			1.911.064,02	**169.874.932,83**	**Zentralstaaten, Art. 114 CRR**	0%	1.911.064,02	0,00
5.	Ansprüche aus Derivatgeschäften				**566.006,57**	**Institute, Art. 119, 120 CRR**			
						Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	1.152.459,77	230.491,95
						Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%	1.771.567,41	885.783,71
Bruttofondsvermögen					**856.320.465,16**		**Summe risikogewichete SA-Positionswerte**		**676.926.736,76**

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % **79,05**

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	104.026,68	0,0134
SEK	0,00	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	5.284,57	0,0007
SGD	620,17	0,0001
PLN	65,40	0,0000
GBP	-48.082,85	0,0062
HUF	0,00	0,0000
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		**0,0204**

Land		Bruttofondsvermögen	Bemessungsgrundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
Niederlande	NL	649.012,09	**0,08**	649.012,09	**0,08**
Grossbritanien	GB	0,00	**0,00**	0,00	**0,00**
Belgien	BE	52.064,39	**0,01**	52.064,39	**0,01**
Luxemburg	LU	0,00	**0,00**	0,00	**0,00**
Österreich	AT	438.793,97	**0,05**	438.793,97	**0,05**
USA	US	245.857.204,54	**28,71**	245.857.204,54	**28,71**
Frankreich	FR	111.758.885,50	**13,05**	111.758.885,50	**13,05**
Italien	IT	149.144.256,77	**17,42**	149.144.256,77	**17,42**
Polen	PL	26.742.394,86	**3,12**	26.742.394,86	**3,12**
Japan	JP	0,00	**0,00**	0,00	**0,00**
Ungarn	HU	0,00	**0,00**	0,00	**0,00**
Singapur	SG	0,00	**0,00**	0,00	**0,00**
Finnland	FI	0,00	**0,00**	0,00	**0,00**
Deutschland	DE	92.905.865,61	**10,85**	92.905.865,61	**10,85**
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)		228.771.987,43	**26,72**	49.378.259,03	**5,77**