

## Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.08.2019  
Sondervermögen: SEB ImmoInvest

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	Risikogewichteter SA-Positionswert
<b>I. IMMOBILIEN</b>		72.610.000,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%	72.610.000,00	72.610.000,00
<b>II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN</b>		210.468.806,45	Beteiligungsriskopositionen Art. 133 C	100%	210.468.806,45	210.468.806,45
<b>III. LIQUIDITÄTSANLAGEN</b>						
1. Bankguthaben		265.306.977,21	Institute, Art. 119 CRR	20%	265.306.977,21	53.061.395,44
2. Termingeld 12 Monate		20.000.000,00	Institute, Art. 120 CRR	50%	20.000.000,00	10.000.000,00
<b>IV. SONSTIGE VERMOGENSGEGENSTÄNDE</b>						
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		10.269.650,39	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	10.269.650,39	10.269.650,39
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		117.180.070,98	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	117.180.070,98	117.180.070,98
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	13.550.000,00		Institute, Art. 120 CRR	50%	13.550.000,00	6.775.000,00
b.) Sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten	2.051.641,70		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	2.051.641,70	2.051.641,70
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter	6.577.720,28		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	6.577.720,28	6.577.720,28
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer	2.041.359,33	24.220.721,31	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	2.041.359,33	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		26.019,96	Institute, Art. 119, 120 CRR			
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	940.580,96	188.116,19
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%	1.265.814,59	632.907,29
<b>Bruttofondsvermögen</b>		<b>720.082.246,30</b>			<b>Summe risikogewichtete SA-Positionswerte</b>	<b>489.815.308,73</b>

**durchschnittliche Risikogewichtszahl in % 68,02**

### Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil	
	EUR	%
USD	148.236,19	0,0228
SEK	0,00	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	5.516,64	0,0008
SGD	623,35	0,0001
PLN	46.941,12	0,0072
GBP	4,92	0,0000
HUF	0,00	0,0000
CZK	0,00	0,0000
<b>Fremdwährungsanteil gesamt</b>		<b>0,0310</b>

Land	Bruttofondsvermögen	Bemessungsgrundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
Niederlande	644.371,17	0,09	644.371,17	0,09
Grossbritannien	0,00	0,00	0,00	0,00
Belgien	52.064,39	0,01	52.064,39	0,01
Luxemburg	0,00	0,00	0,00	0,00
Österreich	438.793,97	0,06	438.793,97	0,06
USA	191.878.736,44	26,65	191.878.736,44	26,65
Frankreich	111.670.849,28	15,51	111.670.849,28	15,51
Italien	1.008.707,77	0,14	1.008.707,77	0,14
Polen	26.701.440,86	3,71	26.701.440,86	3,71
Japan	0,00	0,00	0,00	0,00
Ungarn	0,00	0,00	0,00	0,00
Singapur	0,00	0,00	0,00	0,00
Finnland	0,00	0,00	0,00	0,00
Deutschland	86.762.925,92	12,05	86.762.925,92	12,05
Privilegierte Forderungskategorie (Institute, Zentralstaaten)	300.924.356,50	41,79	70.657.418,93	9,81