

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 30.09.2019
Sondervermögen: SEB ImmoInvest

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	Risikogewichteter SA-Positionswert
I. IMMOBILIEN		72.610.000,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%	72.610.000,00	72.610.000,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		211.408.658,55	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C	100%	211.408.658,55	211.408.658,55
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		186.981.950,03	Institute, Art. 119 CRR	20%	186.981.950,03	37.396.390,01
2. Termingeld 12 Monate		180.000.000,00	Institute, Art. 120 CRR	50%	180.000.000,00	90.000.000,00
IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE						
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		9.926.487,85	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	9.926.487,85	9.926.487,85
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		35.776.736,58	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	35.776.736,58	35.776.736,58
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	14.370.000,00		Institute, Art. 120 CRR	50%	14.370.000,00	7.185.000,00
b.) Sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten	1.665.665,51		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	1.665.665,51	1.665.665,51
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter	6.645.615,85		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	6.645.615,85	6.645.615,85
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer	2.039.357,97	24.720.639,33	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	2.039.357,97	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		23.489,08	Institute, Art. 119, 120 CRR			
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	38.206,94	7.641,39
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%	976.377,80	488.188,90

Bruttofondsvermögen

721.447.961,42

Summe risikogewichtete SA-Positionswerte

473.110.384,63

durchschnittliche Risikogewichtszahl in %

65,58

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	99.771,82	0,0153
SEK	0,00	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	-3,90	0,0000
SGD	-3,86	0,0000
PLN	46.937,90	0,0072
GBP	2.189,52	0,0003
HUF	0,00	0,0000
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		<u><u>0,0229</u></u>

Land	Bruttofondsvermögen	Bemessungs-grundlage 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	111.520.690,11	15,46	111.520.690,11	15,46
Frankreich	111.676.489,38	15,48	111.676.489,38	15,48
Italien	978.192,10	0,14	978.192,10	0,14
Polen	26.683.360,89	3,70	26.683.360,89	3,70
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	86.039.202,33	11,93	86.039.202,33	11,93
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)	383.414.797,08	53,15	135.077.220,29	18,72