

## Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.10.2019  
Sondervermögen: SEB ImmoInvest

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	Risikogewichteter SA-Positionswert = Positionswert
<b>I. IMMOBILIEN</b>		<b>63.940.000,00</b>	<b>Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR</b>	<b>100%</b>	<b>63.940.000,00</b>	<b>63.940.000,00</b>
<b>II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN</b>		<b>197.834.502,74</b>	<b>Beteiligungsriskopositionen Art. 133 C</b>	<b>100%</b>	<b>197.834.502,74</b>	<b>197.834.502,74</b>
<b>III. LIQUIDITÄTSANLAGEN</b>						
1. Bankguthaben		236.908.240,44	Institute, Art. 119 CRR	20%	236.908.240,44	47.381.648,09
2. Termingeld 12 Monate		180.000.000,00	Institute, Art. 120 CRR	50%	180.000.000,00	90.000.000,00
<b>IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE</b>						
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		8.485.009,83	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	8.485.009,83	8.485.009,83
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		414.311,42	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	414.311,42	414.311,42
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	2.020.962,48		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	2.020.962,48	2.020.962,48
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter	6.512.918,67		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	6.512.918,67	6.512.918,67
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer	2.040.123,56	24.944.004,71	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	2.040.123,56	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		434.461,95	Institute, Art. 119, 120 CRR			
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	0,00	0,00
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%	933.354,92	466.677,46
<b>Bruttofondsvermögen</b>		<b>712.960.531,09</b>			<b>Summe risikogewichtete SA-Positionswerte</b>	<b>424.241.030,69</b>

**durchschnittliche Risikogewichtszahl in % 59,50**

### Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil	
	EUR	%
USD	-89.105,72	0,0139
SEK	0,00	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	-7,70	0,0000
SGD	-7,72	0,0000
PLN	-1,16	0,0000
GBP	2.248,70	0,0004
HUF	0,00	0,0000
CZK	0,00	0,0000
<b>Fremdwährungsanteil gesamt</b>		<b>0,0143</b>

Land	Bruttofondsvermögen	Bemessungsgrundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
Niederlande NL	190.060,56	0,03	190.060,56	0,03
Grossbritannien 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	0,06	438.793,97	0,06
USA US	62.550.703,33	8,77	62.550.703,33	8,77
Frankreich FR	111.591.336,83	15,65	111.591.336,83	15,65
Italien IT	978.192,10	0,14	978.192,10	0,14
Polen PL	26.676.242,79	3,74	26.676.242,79	3,74
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	76.730.311,17	10,76	76.730.311,17	10,76
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)	433.752.825,95	60,84	145.033.325,55	20,34