

## Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 30.11.2019  
Sondervermögen: SEB ImmoInvest

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	Risikogewichteter SA-Positionswert
<b>I. IMMOBILIEN</b>		63.940.000,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%	63.940.000,00	63.940.000,00
<b>II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN</b>		198.540.730,04	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C	100%	198.540.730,04	198.540.730,04
<b>III. LIQUIDITÄTSANLAGEN</b>						
1. Bankguthaben		394.139.355,92	Institute, Art. 119 CRR	20%	394.139.355,92	78.827.871,18
2. Termingeld 12 Monate		20.000.000,00	Institute, Art. 120 CRR	50%	20.000.000,00	10.000.000,00
<b>IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE</b>						
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		8.701.617,91	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	8.701.617,91	8.701.617,91
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	2.029.052,80		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	2.029.052,80	2.029.052,80
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter	6.599.737,27		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	6.599.737,27	6.599.737,27
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer	2.042.707,52	25.041.497,59	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	2.042.707,52	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		142.587,61	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%	649.535,22	324.767,61
<b>Bruttofondsvermögen</b>		<b>710.920.100,49</b>			<b>Summe risikogewichtete SA-Positionswerte</b>	<b>376.563.088,23</b>

**durchschnittliche Risikogewichtszahl in % 52,97**

### Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	-114.362,50	0,0179
SEK	0,00	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	0,00	0,0000
PLN	-1,14	0,0000
GBP	2.271,13	0,0004
HUF	0,00	0,0000
CZK	0,00	0,0000
<b>Fremdwährungsanteil gesamt</b>		<b>0,0182</b>

Land	Bruttofondsvermögen	Bemessungs-grundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
Niederlande	190.060,56	0,03	190.060,56	0,03
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	63.678.260,06	8,96	63.678.260,06	8,96
Frankreich	111.515.384,96	15,69	111.515.384,96	15,69
Italien	978.192,10	0,14	978.192,10	0,14
Polen	26.662.371,43	3,75	26.662.371,43	3,75
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	76.710.321,97	10,79	76.710.321,97	10,79
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)	430.694.651,05	60,58	96.337.638,79	13,55