

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.12.2019
Sondervermögen: SEB ImmoInvest

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	Risikogewichteter SA-Positionswert
I. IMMOBILIEN		63.940.000,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%	63.940.000,00	63.940.000,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		171.191.165,09	Beteiligungsriskopositionen Art. 133 C	100%	171.191.165,09	171.191.165,09
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		119.465.069,28	Institute, Art. 119 CRR	20%	119.465.069,28	23.893.013,86
2. Termingeld 12 Monate		20.000.000,00	Institute, Art. 120 CRR	50%	20.000.000,00	10.000.000,00
IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE						
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		8.685.895,24	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	8.685.895,24	8.685.895,24
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	12.570.000,00		Institute, Art. 120 CRR	50%	12.570.000,00	6.285.000,00
b.) Sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten	1.665.834,98		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	1.665.834,98	1.665.834,98
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter	6.479.420,86		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	6.479.420,86	6.479.420,86
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer	2.042.727,77	22.757.983,61	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	2.042.727,77	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		466.300,72	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%	710.206,35	355.103,17
Bruttofondsvermögen		406.920.725,36			Summe risikogewichtete SA-Positionswerte	292.909.744,62

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % 71,98

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil	
	EUR	%
USD	53.688,89	0,0159
SEK	0,00	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	0,00	0,0000
PLN	-1,16	0,0000
GBP	-65,22	0,0000
HUF	0,00	0,0000
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		0,0159

Land	Bruttofondsvermögen	Bemessungsgrundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
Niederlande	NL 180.314,46	0,04	180.314,46	0,04
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	0,11	438.793,97	0,11
USA	US 36.188.949,38	8,89	36.188.949,38	8,89
Frankreich	FR 111.472.620,01	27,39	111.472.620,01	27,39
Italien	IT 978.192,10	0,24	978.192,10	0,24
Polen	PL 153.685,10	0,04	153.685,10	0,04
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 102.912.008,18	25,29	102.912.008,18	25,29
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)	154.544.097,77	37,98	40.533.117,03	9,96