

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.03.2020
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		170.212.385,18	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C	100%	170.212.385,18	170.212.385,18
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		125.515.897,63	Institute, Art. 119 CRR	20%	125.515.897,63	25.103.179,53
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		8.071.731,05	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	8.071.731,05	8.071.731,05
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		414.311,44	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	414.311,44	414.311,44
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	3.020.000,00		Institute, Art. 120 CRR	50%	3.020.000,00	1.510.000,00
b.) Sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten	1.710.425,44		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	1.710.425,44	1.710.425,44
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter	813.730,47		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	813.730,47	813.730,47
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer	2.043.373,91	7.587.529,82	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	2.043.373,91	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		76.499,53	Institute, Art. 119, 120 CRR			
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	243.740,19	48.748,04
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20%	176.607,38	35.321,48
Bruttofondsvermögen		395.818.354,65			Summe risikogewichtete SA-Positionswerte	281.859.832,62

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % 71,21

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%	Land	Bruttofondsvermögen	Bemessungs-grundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
USD	-3.369,18	-0,0010	Niederlande	30.700,09	0,01	30.700,09	0,01
SEK	0,00	0,0000	Grossbritannien	0,00	0,00	0,00	0,00
CNY	0,00	0,0000	Belgien	54.444,89	0,01	54.444,89	0,01
JPY	0,00	0,0000	Luxemburg	0,00	0,00	0,00	0,00
SGD	0,00	0,0000	Österreich	475.889,78	0,12	475.889,78	0,12
PLN	-1.669,54	-0,0005	USA	29.951.112,22	7,57	29.951.112,22	7,57
GBP	0,00	0,0000	Frankreich	111.110.218,61	28,07	111.110.218,61	28,07
HUF	0,00	0,0000	Italien	2.437.843,77	0,62	2.437.843,77	0,62
CZK	0,00	0,0000	Polen	163.173,35	0,04	163.173,35	0,04
Fremdwährungsanteil gesamt	-0,0015		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	100.939.200,87	25,50	100.939.200,87	25,50
			Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)	150.655.771,07	38,06	36.697.249,04	9,27