

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 30.04.2020
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		170.194.506,16	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C	100%	170.194.506,16	170.194.506,16
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		133.880.703,35	Institute, Art. 119 CRR	20%	133.880.703,35	26.776.140,67
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		6.240.512,24	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	6.240.512,24	6.240.512,24
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		1.052.133,72	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	1.052.133,72	1.052.133,72
3. Zinsansprüche aus befristeten Bankguthaben		0,00	Institute, Art. 120 CRR	50%	0,00	0,00
aus Wertpapieren		0,00		50%	0,00	0,00
4. Sonstige Forderungen						
a.) Margin Account Devisentermingeschäfte Kontrahent KI	2.270.000,00		Institute, Art. 120 CRR	50%	2.270.000,00	1.135.000,00
b.) Sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten	152.014,74		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	152.014,74	152.014,74
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter	445.923,38		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	445.923,38	445.923,38
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer	2.270.681,13	5.138.619,25	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	2.270.681,13	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		69.540,49	Institute, Art. 119, 120 CRR			
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs- /Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	238.203,83	47.640,77
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20%	178.291,96	35.658,39
Bruttofondsvermögen		400.516.015,21			Summe risikogewichtete SA-Positionswerte	280.019.530,07

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % 69,91

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil	
	EUR	%
USD	-125.628,28	-0,0373
SEK	0,00	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	0,00	0,0000
PLN	-1.674,23	-0,0005
GBP	0,00	0,0000
HUF	0,00	0,0000
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		-0,0378

Land	Bruttofondsvermögen	Bemessungs-grundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
Niederlande	20.287,73	0,01	20.287,73	0,01
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	440.334,73	0,11	440.334,73	0,11
USA	30.003.233,18	7,49	30.003.233,18	7,49
Frankreich	110.632.368,62	27,62	110.632.368,62	27,62
Italien	936.210,29	0,23	936.210,29	0,23
Polen	144.278,06	0,04	144.278,06	0,04
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	99.796.313,24	24,92	99.796.313,24	24,92
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)	158.490.924,97	39,57	37.994.439,83	9,49