

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.07.2020
Sondervermögen: SEB ImmoInvest

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	Risikogewichteter SA-Positionswert = Positionswert
I. IMMOBILIEN		58.790.000,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%	58.790.000,00	58.790.000,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		148.620.743,89	Beteiligungsriskopositionen Art. 133 C	100%	148.620.743,89	148.620.743,89
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		75.327.557,81	Institute, Art. 119 CRR	20%	75.327.557,81	15.065.511,56
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		6.616.208,77	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	6.616.208,77	6.616.208,77
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		422.150,83	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	422.150,83	422.150,83
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	2.270.000,00		Institute, Art. 120 CRR	50%	2.270.000,00	1.135.000,00
b.) Sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten	1.097.249,65		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	1.097.249,65	1.097.249,65
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	1.963.396,62	5.776.569,65	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	1.963.396,62	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		1.033.641,67	Institute, Art. 119, 120 CRR			
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	1.185.680,25	237.136,05
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20%	15.089,71	3.017,94
Bruttofondsvermögen		316.586.872,62			Summe risikogewichtete SA-Positionswerte	242.432.942,07

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % 76,58

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil	
	EUR	%
USD	1.044.127,87	0,3951
SEK	0,00	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	0,00	0,0000
PLN	-1.150,85	-0,0004
GBP	0,00	0,0000
HUF	0,00	0,0000
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		0,3951

Land	Bruttofondsvermögen	Bemessungsgrundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
Niederlande	NL 20.287,73	0,01	20.287,73	0,01
Grossbritannien	GB 0,00	0,00	0,00	0,00
Belgien	BE 52.064,39	0,02	52.064,39	0,02
Luxemburg	LU 0,00	0,00	0,00	0,00
Österreich	AT 440.334,73	0,14	440.334,73	0,14
USA	US 8.663.418,40	2,74	8.663.418,40	2,74
Frankreich	FR 110.465.989,95	34,89	110.465.989,95	34,89
Italien	IT 936.210,29	0,30	936.210,29	0,30
Polen	PL 148.664,86	0,05	148.664,86	0,05
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 95.265.306,17	30,09	95.265.306,17	30,09
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)	100.594.596,10	31,77	26.440.665,55	8,35