

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 30.09.2020
Sondervermögen: SEB ImmoInvest

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	Risikogewichteter SA-Positionswert
I. IMMOBILIEN		44.600.000,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%	44.600.000,00	44.600.000,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		135.365.823,37	Beteiligungsriskopositionen Art. 133 C	100%	135.365.823,37	135.365.823,37
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		106.484.380,35	Institute, Art. 119 CRR	20%	106.484.380,35	21.296.876,07
2. Termingeld 12 Monate			Institute, Art. 120 CRR	50%	0,00	0,00
IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE						
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		6.774.356,92	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	6.774.356,92	6.774.356,92
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		387.275,42	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	387.275,42	387.275,42
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		0,00	Institute, Art. 120 CRR	50%	0,00	0,00
b.) Sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten		1.116.236,62	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	1.116.236,62	1.116.236,62
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		1.953.840,89	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	1.953.840,89	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		38.006,01	Institute, Art. 119, 120 CRR			
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	69.686,26	13.937,25
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20%	0,00	0,00
Bruttofondsvermögen		297.165.842,96			Summe risikogewichtete SA-Positionswerte	210.000.429,03

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % 70,67

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	40.768,68	0,0266
SEK	0,00	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	0,00	0,0000
PLN	-1.114,65	-0,0007
GBP	0,00	0,0000
HUF	0,00	0,0000
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		0,0266

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	0,15	440.334,73	0,15
USA US	-1.480.069,33	-0,50	-1.480.069,33	-0,50
Frankreich FR	110.362.846,01	37,14	110.362.846,01	37,14
Italien IT	936.210,29	0,32	936.210,29	0,32
Polen PL	143.989,15	0,05	143.989,15	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	78.213.952,74	26,32	78.213.952,74	26,32
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)	108.476.227,25	36,50	21.310.813,32	7,17