

## Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.10.2020  
Sondervermögen: SEB ImmoInvest

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	Risikogewichteter SA-Positionswert
<b>I. IMMOBILIEN</b>		<b>44.600.000,00</b>	<b>Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR</b>	100%	44.600.000,00	44.600.000,00
<b>II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN</b>		<b>131.369.536,87</b>	<b>Beteiligungsriskopositionen Art. 133 C</b>	100%	131.369.536,87	131.369.536,87
<b>III. LIQUIDITÄTSANLAGEN</b>						
1. Bankguthaben		110.121.884,86	Institute, Art. 119 CRR	20%	110.121.884,86	22.024.376,97
2. Termingeld 12 Monate			Institute, Art. 120 CRR	50%	0,00	0,00
<b>IV. SONSTIGE VERMOGENSGEGENSTÄNDE</b>						
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		6.325.222,28	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	6.325.222,28	6.325.222,28
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		415.366,92	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	415.366,92	415.366,92
3. Zinsansprüche aus befristeten Bankguthaben aus Wertpapieren			Institute, Art. 120 CRR	50%	0,00	0,00
4. Sonstige Forderungen				50%	0,00	0,00
a.) Margin Account Devisentermingeschäfte Kontrahent KI		0,00	Institute, Art. 120 CRR	50%	0,00	0,00
b.) Sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten		1.073.042,70	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	1.073.042,70	1.073.042,70
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		457.784,93	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	457.784,93	457.784,93
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer		1.954.301,89	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	1.954.301,89	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		62.115,11	Institute, Art. 119, 120 CRR			
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	93.613,87	18.722,77
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20%	0,00	0,00
<b>Bruttofondsvermögen</b>		<b>296.379.255,56</b>			<b>Summe risikogewichtete SA-Positionswerte</b>	<b>206.284.053,45</b>

**durchschnittliche Risikogewichtszahl in % 69,60**

### Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	42.845,53	0,0169
SEK	0,00	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	0,00	0,0000
PLN	-1.095,58	-0,0004
GBP	0,00	0,0000
HUF	0,00	0,0000
CZK	0,00	0,0000
<b>Fremdwährungsanteil gesamt</b>		<b>0,0169</b>

Land	Bruttofondsvermögen	Bemessungsgrundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
Niederlande NL	0,00	0,00	0,00	0,00
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	-5.364.344,45	-1,81	-5.364.344,45	-1,81
Frankreich FR	110.310.997,02	37,22	110.310.997,02	37,22
Italien IT	915.898,85	0,31	915.898,85	0,31
Polen PL	141.526,13	0,05	141.526,13	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	77.744.477,03	26,23	77.744.477,03	26,23
Privilegierte Forderungskategorie (Institute, Zentralstaaten)	112.138.301,86	37,84	22.043.099,75	7,44