

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 30.11.2020
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		136.654.622,13	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C	100%	136.654.622,13	136.654.622,13
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		110.076.589,48	Institute, Art. 119 CRR	20%	110.076.589,48	22.015.317,90
2. Termingeld 12 Monate			Institute, Art. 120 CRR	50%	0,00	0,00
IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE						
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		6.422.913,84	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	6.422.913,84	6.422.913,84
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		414.311,42	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	414.311,42	414.311,42
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		1.070.595,04	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	1.070.595,04	1.070.595,04
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		457.473,79	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	457.473,79	457.473,79
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer		2.259.440,69	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	2.259.440,69	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		20.883,53	Institute, Art. 119, 120 CRR			
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	37.559,46	7.511,89
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20%	0,00	0,00
Bruttofondsvermögen		301.976.829,92			Summe risikogewichtete SA-Positionswerte	211.642.746,01
					durchschnittliche Risikogewichtszahl in %	70,09

Bruttofondsvermögen

301.976.829,92

Summe risikogewichtete SA-Positionswerte

211.642.746,01

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % 70,09

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%	Land	Bruttofondsvermögen	Bemessungsgrundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
USD	393.585,59	0,1555	Niederlande	0,00	0,00	0,00	0,00
SEK	0,00	0,0000	Grossbritannien	0,00	0,00	0,00	0,00
CNY	0,00	0,0000	Belgien	52.064,39	0,02	52.064,39	0,02
JPY	0,00	0,0000	Luxemburg	0,00	0,00	0,00	0,00
SGD	0,00	0,0000	Österreich	440.334,73	0,15	440.334,73	0,15
PLN	432.589,41	0,1709	USA	11.553,38	0,00	11.553,38	0,00
GBP	0,00	0,0000	Frankreich	110.252.853,71	36,51	110.252.853,71	36,51
HUF	0,00	0,0000	Italien	915.898,85	0,30	915.898,85	0,30
CZK	0,00	0,0000	Polen	146.437,77	0,05	146.437,77	0,05
Fremdwährungsanteil gesamt	0,3265		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	77.800.773,39	25,76	77.800.773,39	25,76
			Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)	112.356.913,70	37,21	22.022.829,79	7,29