

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz) gemäß CRR11

Datum: 31.05.2021
Sondervermögen: SEB Global Property Fund

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht X	Positionswert	Risikogewichteter SA-Positionswert
I. IMMOBILIEN		0,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%		0,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		2.976.699,06	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C	100%	2.976.699,06	2.976.699,06
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		16.870.707,87	Institute, Art. 119 CRR	20%	16.870.707,87	3.374.141,57
2. Termingeld 12 Monate			Institute, Art. 120 CRR	50%	0,00	0,00
IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE						
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		0,00	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	0,00	0,00
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		0,00	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	0,00	0,00
3. Zinsansprüche aus befristeten Bankguthaben		0,00	Institute, Art. 120 CRR	50%	0,00	0,00
4. Sonstige Forderungen Debitorisches Kreditoren						
a.) Zahlungen auf noch nicht erworbene Objekte - an Verkäufer	0,00		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	0,00	0,00
- auf Notaranderkonto	0,00		Institute, Art. 120 CRR	50%	0,00	0,00
b.) sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten/Debitorisches Kredi.	772,20		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	772,20	772,20
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter	0,00		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	0,00	0,00
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus	56.022,80	56.795,00	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	56.022,80	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		0,00	Institute, Art. 119, 120 CRR			
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	0,00	0,00
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%	0,00	0,00
Bruttofondsvermögen		19.904.201,93			Summe risikogewichtete SA-Positionswerte	6.351.612,83
Nettofondsvermögen (Bruttofondsverm. abzgl. Verblkt. und Rückstellg.)		16.640.294,64			durchschnittliche Risikogewichtszahl gemäß CRR11 in %	38,17

Fremdwährungsanteil				Land	Bruttofondsvermögen	Bemessungsgrundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
		Ungesicherter Fremdwährungsanteil		Niederlande	NL	0,00	0,00	0,00
		EUR	%	Polen	PL	2.311.343,62	11,61	13,89
USD		182.092,99	1,0901	USA	US	0,00	0,00	0,00
SEK		0,00	0,0000	Deutschland	DE	666.127,64	3,35	4,00
CNY		0,00	0,0000	Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)		16.926.730,67	85,04	20,28
JPY		0,00	0,0000					
SGD		0,00	0,0000					
PLN		206.687,15	1,2644					
HUF		0,00	0,0000					
Fremdwährungsanteil gesamt			2,3545					