

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 28.02.2021
Sondervermögen: SEB ImmoInvest

	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	0,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		112.417.288,21	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C	100%	112.417.288,21	112.417.288,21
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		82.288.677,17	Institute, Art. 119 CRR	20%	82.288.677,17	16.457.735,43
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		5.685.745,60	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	5.685.745,60	5.685.745,60
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		1.065.772,99	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	1.065.772,99	1.065.772,99
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		457.354,61	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	457.354,61	457.354,61
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer		2.107.316,90	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	2.107.316,90	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)	20%	0,00	0,00
Bruttofondsvermögen		224.436.466,90			Summe risikogewichtete SA-Positionswerte	146.498.208,26
					durchschnittliche Risikogewichtszahl in %	65,27

Fremdwährungsanteil				Land	Bruttofondsvermögen	Bemessungsgrundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
		Ungesicherter Fremdwährungsanteil		Niederlande	NL	0,00	0,00	0,00
		EUR	%	Grossbritannien	GB	0,00	0,00	0,00
USD		507.301,47	0,2890	Belgien	BE	52.064,39	52.064,39	0,02
SEK		0,00	0,0000	Luxemburg	LU	0,00	0,00	0,00
CNY		0,00	0,0000	Österreich	AT	440.334,73	440.334,73	0,20
JPY		0,00	0,0000	USA	US	11.434,20	11.434,20	0,01
SGD		0,00	0,0000	Frankreich	FR	110.102.853,71	110.102.853,71	49,06
PLN		439.082,05	0,2502	Italien	IT	915.898,85	915.898,85	0,41
GBP		0,00	0,0000	Polen	PL	148.558,83	148.558,83	0,07
HUF		0,00	0,0000	Japan	JP	0,00	0,00	0,00
CZK		0,00	0,0000	Ungarn	HU	0,00	0,00	0,00
Fremdwährungsanteil gesamt		0,5392		Singapur	SG	0,00	0,00	0,00
				Finnland	FI	0,00	0,00	0,00
				Deutschland	DE	8.369.328,12	8.369.328,12	3,73
				Privilegierte Forderungskategorie (Institute, Zentralstaaten)		104.395.994,07	26.457.735,43	11,79